

PROJECT C+E

너에게 모든  
것을 바칩니다.  
최마정애.

# FINAL PROJECT



6차 회의 - 업무 브리핑



**업무 브리핑**



**기타 논의**

2022 04/27 비주식팀 업무 브리핑

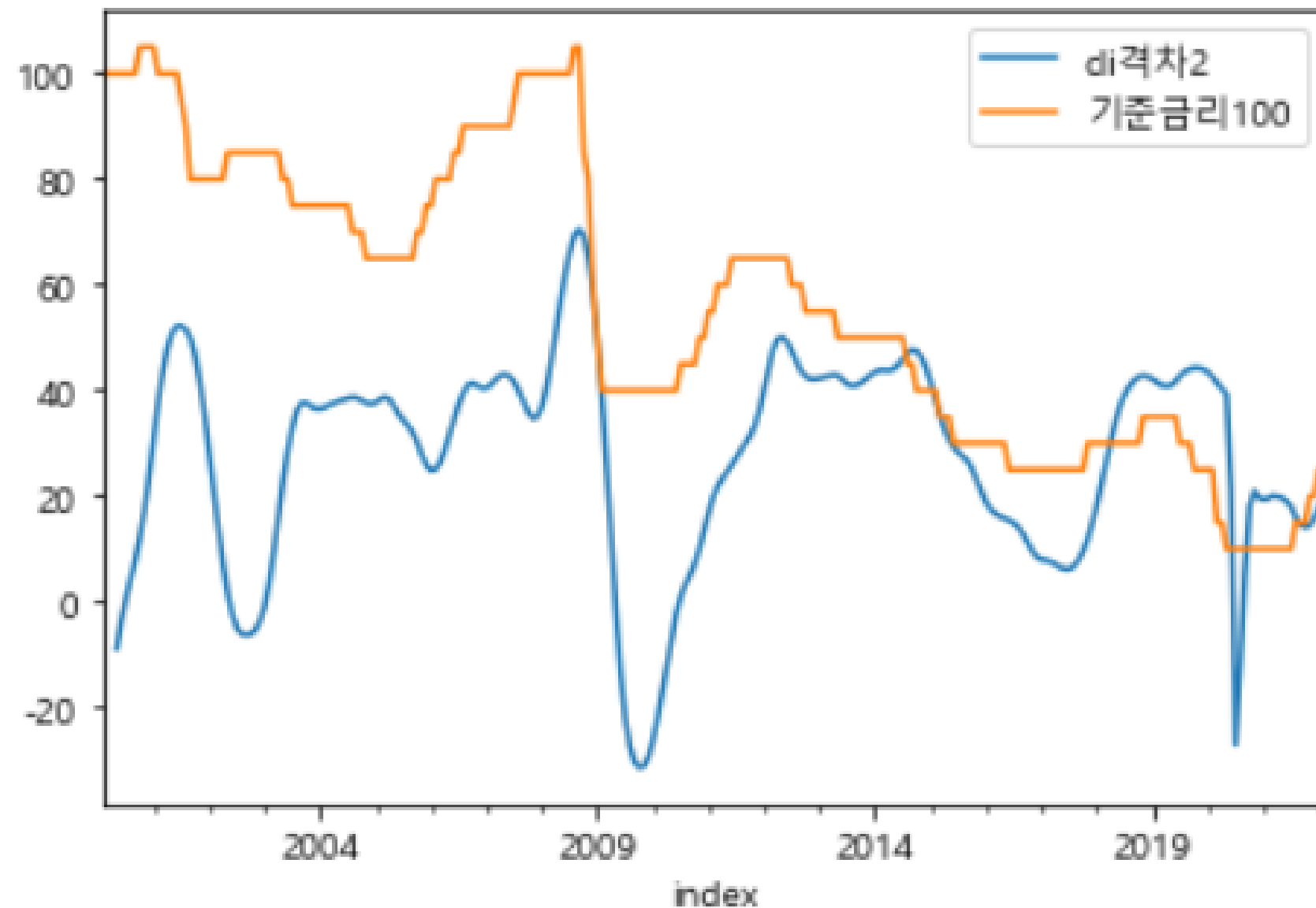
업무 내용	데이터 셋 예시 작성 - 작성완료 금리 선행지수 관련해서 시그널 만들기 - 만드는 중, 가이드라인 찾음 채권 데이터 수집 방안 모색 - API 주소까지 확보 (함수만 만들면됨), 딥서치 api도 확인
결과	금리 선행지수 시그널 만듦. - 유의미하기도함 하지만 더 참고하여 고도화 시킬 수 있는 사이트를 발견하여 기준으로 삼고 시그널을 고도화 시킬 계획임 채권 데이터의 경우, 공공데이터 API 사용법을 익혀놓음, 딥서치도 참고할만하지만 시세 데이터를 따로 제공하지 않는 것으로 보아 공공데이터 API를 활용할 듯.
미비점 및 피드백 사항	미비점 없음. 너무 잘됨.
내일 업무 내용	뉴스크롤링 빈도 데이터 수집방안 모색

# 비주식팀 업무 브리핑



	A	B	C	D	E	F	G	H	I
1	거시경제	(지표선택중)	수집 경로: ECOS API	OECD API					
2	날짜	미국cli	한국cli	기준금리	환율	미국금리	M1	M2	소비자물가상승률(%)
3	2022-04-01	100.0564	100.3716	1.25	1,262	0.125	1368003100000000	3,653,013,900,000,000.00	0.5
4									
5	채권	(일단 국채만)	수집 경로 : 금융투자협회						
6	날짜	종목명	잔존만기	년물	평가수익률(표면이율)	평가가격			
7	2022-04-27	국고02125-2403(22-3)	01.10.13	2	3.2	9,657			
8									
9	주식	수집 경로: pykrx API							
10	날짜	종목코드	종목명	시장	종가	전일대비	전일대비등락률	시가	시가총액
11	2022-04-27	005930	삼성전자	KOSPI	66300	-700	-1.044	66500	395,796,583,065,000
12									
13	재무제표	수집 경로: FnSPACE, 딥서치							
14	분기	종목코드	현금배당수익률	유동비율	매출액	당기순이익	ROE	ROA	실적발표일
15	200512	005930	0.03	0.61	56,156,130,000	#####	0.5	0.2	20060213
16	금 ETF	수집 경로 : investing.com							
17	날짜	IAU							
18	2022-04-27	36.11							
19									
20	원자재 ETF	수집 경로 : investing.com							
21	날짜	DBC							
22	2022-04-27	27.32							
23									
24	환율	수집 경로: ECOS API							
25	날짜	달러-원화 환율							
26	2022-04-27	1,262							
27									

데이터셋 예시 제작 완료.



한국, 미국 CLI를 MinMax스케일링하여 변동폭의 민감도 조절  
한국, 미국 CLI의 격차를 시그널로 판단하였을때,  
3개월 후 금리와 유의미한 관계가 있는 것으로 판단됨.

But, 모멘텀 등 기술지표를 활용해 경기 국면을 분류할 수 있는  
방법론이 있는 사이트를 발견하여 참고 후 시그널을 고도화할 예정

2022 04/27 주식팀 업무 브리핑

업무 내용	포트폴리오 종목수 결정 재무요소 비율 기준을 점수화 하는 선택조건이 없는 것들 찾아오기 데이터프레임 핸들링 민형 - 배당, 시장가치, 강호 - 생산성, 레버리지 지표, 홍정 - 유동성, 활동성, 승희 - 성장성, 수익성
결과	포트폴리오 종목 선정 개수 (5개, 10개, 상위50) 수익률 -- 선정완료 - 시가총액 가중방식 - 동일균등방식 재무요소 항목들의 선택 조건 세우기 (그레이엄, 워렌 버핏, 피터린치)
미비점 및 피드백 사항	다들 열심히 잘해주고계셔서 좋아요. 지금처럼 열심히 참여하고 의견 내주시면 행복사합니다.
내일 업무 내용	1.주가를 이용해서 재무요소를 구해야 per,pbr ,실시간으로 불러와서 짜야합니다. 2.함수코딩짜야합니다. 3.함수코딩짜면서 데이터충돌이일어날수있어요. 데이터 잘 가져올수있도록 가공해야해요. 입맛에 맞게.



**FINAL PROJECT**

---