

PROJECT C+E

너에게 모든
것을 바칩니다.
최마정애.

FINAL PROJECT



14차 회의 - 업무 브리핑



업무 브리핑



기타 논의

2022 05/10 비주식팀 업무 브리핑

업무 내용/
결과

LSTM 모델링 이후, 기간별 포트폴리오 성과 분석 및 튜닝
기간 별 포트폴리오 가중치 DF를 만든 이후 백테스팅에 이용할 예정임

미비점
및
피드백 사항

변동성이 큰 구간을 학습하지 않으면 포트폴리오 구성이 제대로 되지 않음..
→ 금지막한 사건(리먼, 코로나)을 제외한 기간에 백테스팅이 이루어져야 할 듯

내일 업무 내용

계속 LSTM 포폴 성과평가와 튜닝... 및 가중치 DF 만들기

2022 05/10 주식팀 업무 브리핑

업무 내용/
결과

강호 - 분기데이터 6개월간 추이 및 종목 선정 완료. 국면 기준에 비슷하게 부합하는것을 대략적으로 볼 수 있었습니다.
민형 - obv 매수매도 시그널 잡으려고 시도 but backtrader 사용, 매수매도 사인은 나왔는데 수익률 구하는데까지는 어려움 있었음. 골든크로스 시도 및 해석중
승희 - macd 수익률 비교하는 것 까지 완료. 맞춰서 비교해보면 될듯합니다.
홍정 - 200평선 기준 백테스팅 ok 선정된 종목의 연간 단순 수익률과 기술적 (200평선) 기준 지표 비교하기위해 코딩중

미비점
및
피드백 사항

체력관리 잘하고 힘을 내보아요.

내일 업무 내용

백테스팅 분석및 (수익률 국면에 맞게 수정) 계속 진행

컨트롤 엔터 파이팅!!



```
# 국면.to_csv('국면.csv',index=False)
```

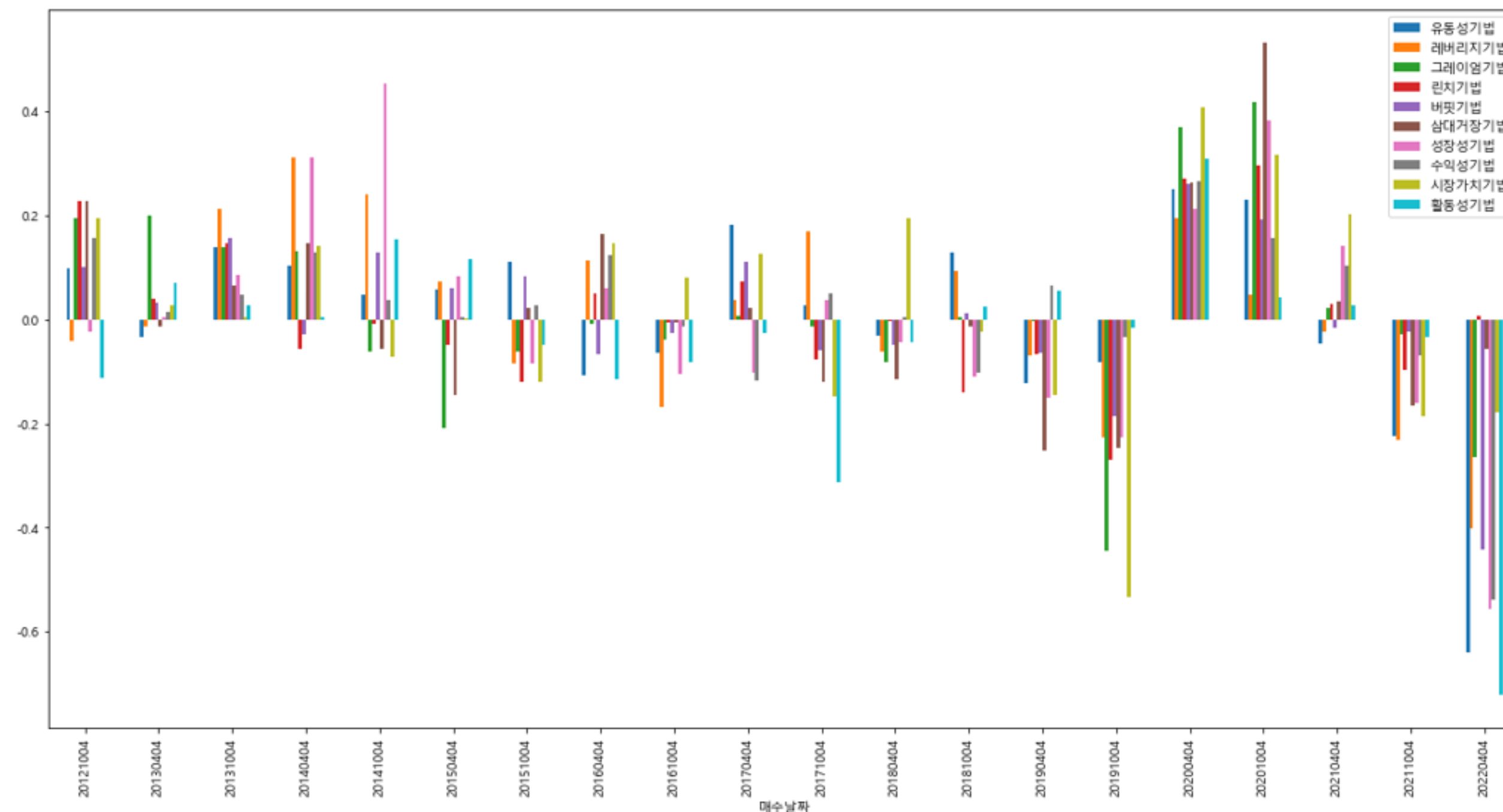
국면 시작과 끝

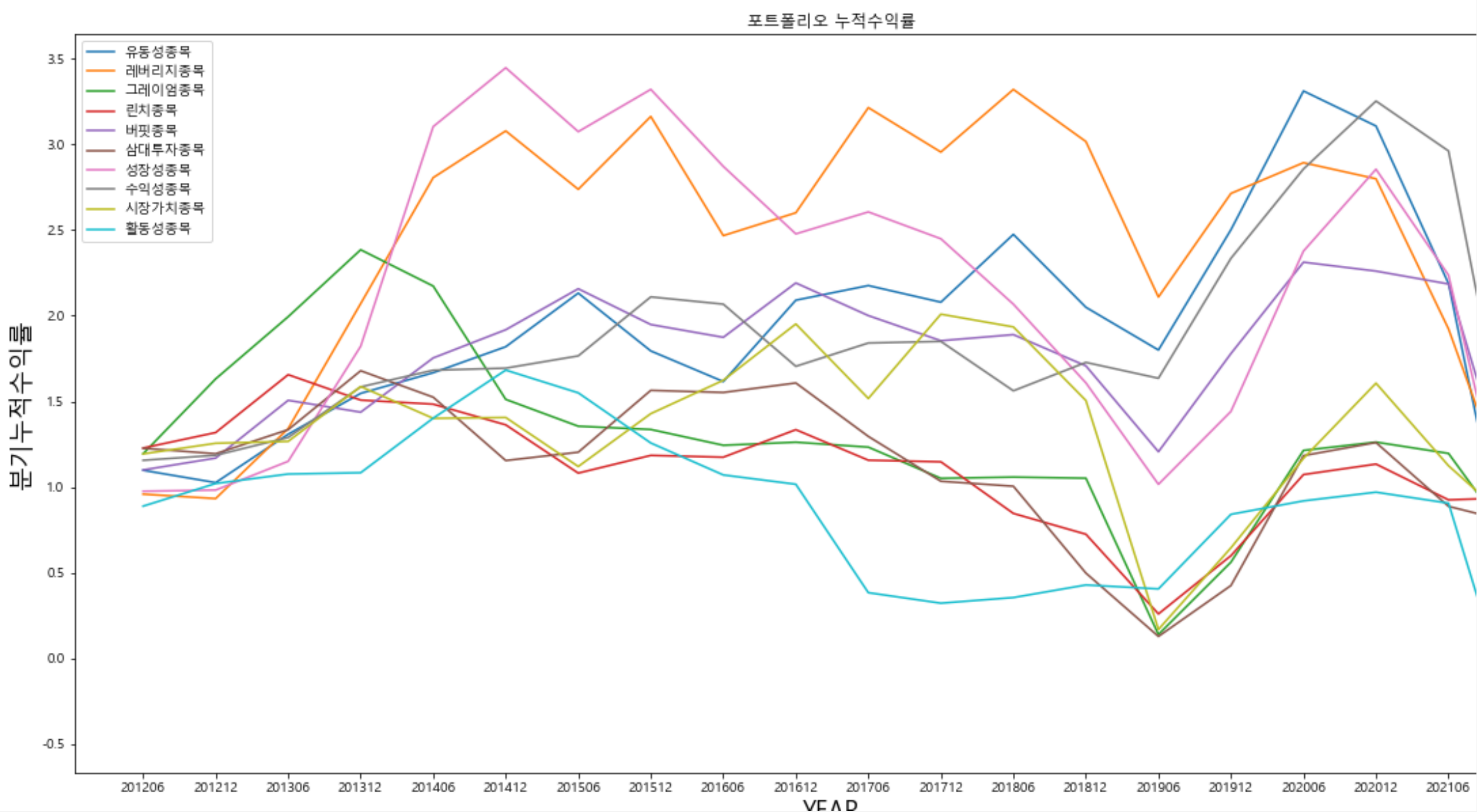
```
국면 = pd.read_csv('./국면.csv')
```

```
국면.iloc[23:]
```

	시작	끝	국면
23	2012-03-01	2013-09-01	회복
24	2013-10-01	2014-08-01	위축
25	2014-09-01	2014-12-01	회복
26	2015-01-01	2015-05-01	확장
27	2015-06-01	2015-09-01	둔감
28	2015-10-01	2016-01-01	확장
29	2016-02-01	2016-04-01	둔감
30	2016-05-01	2017-06-01	확장
31	2017-07-01	2018-06-01	둔감
32	2018-07-01	2019-11-01	위축
33	2019-12-01	2020-03-01	회복
34	2020-04-01	2020-06-01	위축
35	2020-07-01	2020-12-01	회복
36	2021-01-01	2021-08-01	확장
37	2021-09-01	2022-05-01	둔감

<AxesSubplot:xlabel='매수날짜'>







FINAL PROJECT