

PROJECT C+E

너에게 모든
것을 바칩니다.
최마정애.

FINAL PROJECT



5차 회의 - 업무 브리핑



업무 브리핑



기타 논의

2022 04/26 비주식팀 업무 브리핑

업무 내용	거시경제 분석(경기선행지수 데이터를 수집하여 6개월후 금리와 비교) 머신러닝 (ARIMA, 회귀분석)을 통해 미래 금리 예측 모델을 구축 시도
결과	채권 전략을 하려고 했으나, 거시경제 추세에 따른 전략이 나누어져 있어 거시경제 분석에 집중하기로함 머신러닝 (ARIMA, 회귀분석)을 통해 미래 금리 예측 모델을 구축하려고 했으나, 결과가 좋지 않았음 경기선행지수 데이터를 수집하여 6개월후 금리와 비교한 결과 유의미한 결과를 얻을 수 있었음
미비점 및 피드백 사항	경기선행지수와 기준금리 높은 상관관계를 보이지만, 다른 지표들을 추가하여 더 디테일하게 시그널 만들 필요성이 있음.
내일 업무 내용	기준금리 시그널 만들기, 채권 투자 전략 구현 시작하기, 뉴스크롤링 빈도 데이터 수집방안 모색

ARMA Model Results

```

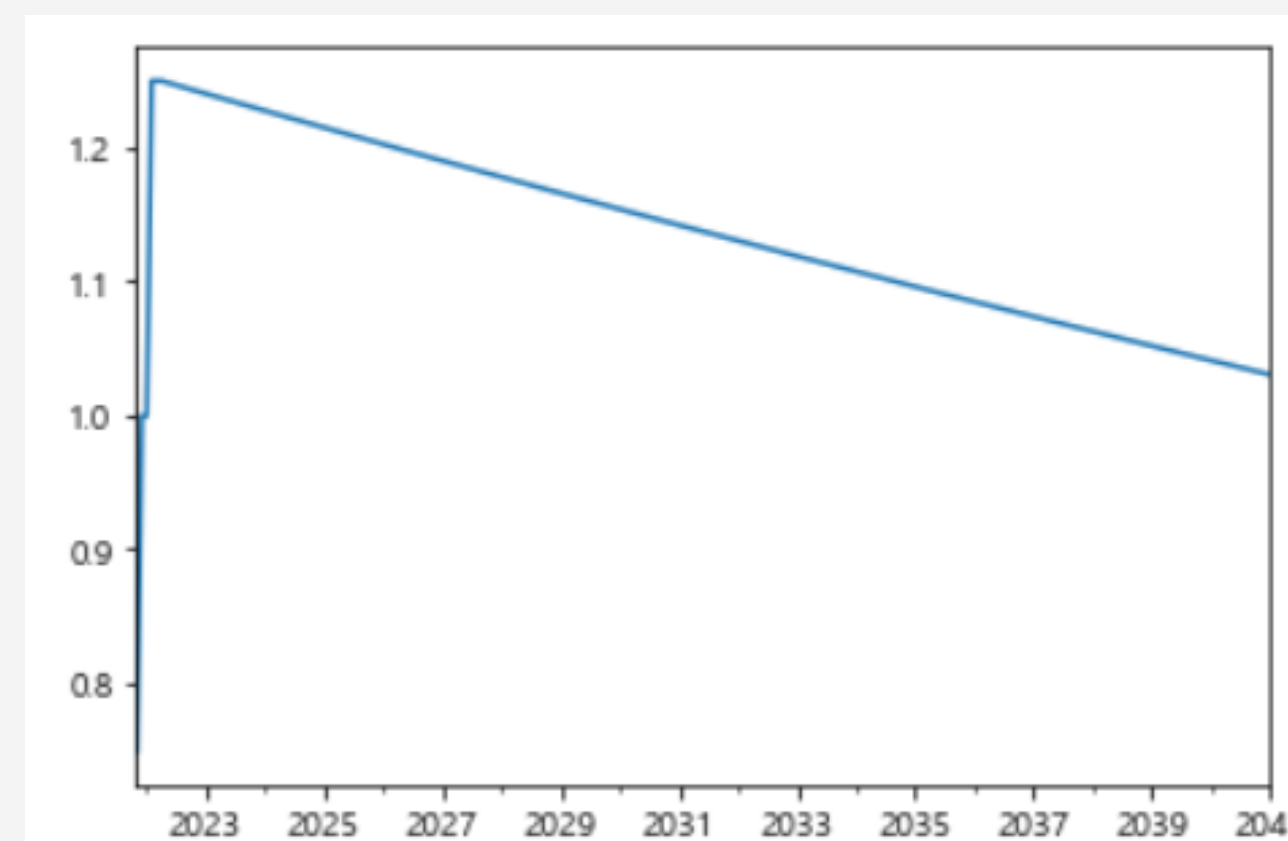
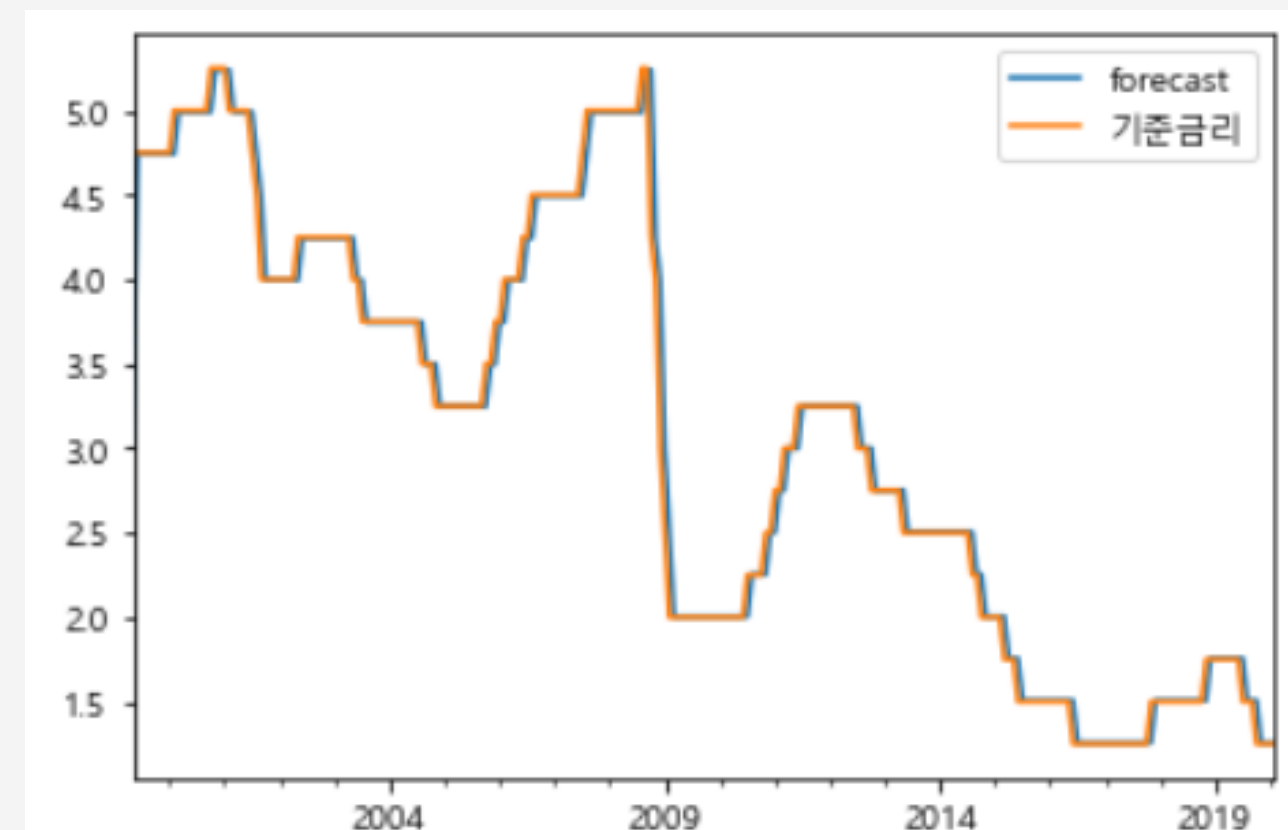
=====
Dep. Variable:      기준금리    No. Observations:      250
Model:              ARMA(1, 0)  Log Likelihood        130.624
Method:             css-mle    S.D. of innovations    0.142
Date:               Tue, 26 Apr 2022  AIC                -257.247
Time:               16:25:02    BIC                 -250.204
Sample:             05-01-1999  HQIC                -254.413
                   - 02-01-2020
=====

```

	coef	std err	z	P> z	[0.025	0.975]
ar.L1.기준금리	0.9992	0.001	915.997	0.000	0.997	1.001

Roots

	Real	Imaginary	Modulus	Frequency
AR.1	1.0008	+0.0000j	1.0008	0.0000



```
df_ir=df_ir.dropna()
y_target = df_ir['담달기준금리']
X_data = df_ir.drop(['담달기준금리','index'],axis=1)

#데이터셋 나누기(train, test)
X_train,X_test,y_train,y_test = train_test_split(X_data, y_target, test_size=0.3, random_state=123)
#모델 사용
model = ElasticNet(alpha=1.0, l1_ratio=0.5, random_state = 1234)
model.fit(X_train,y_train)
y_preds = model.predict(test2)
```

test2

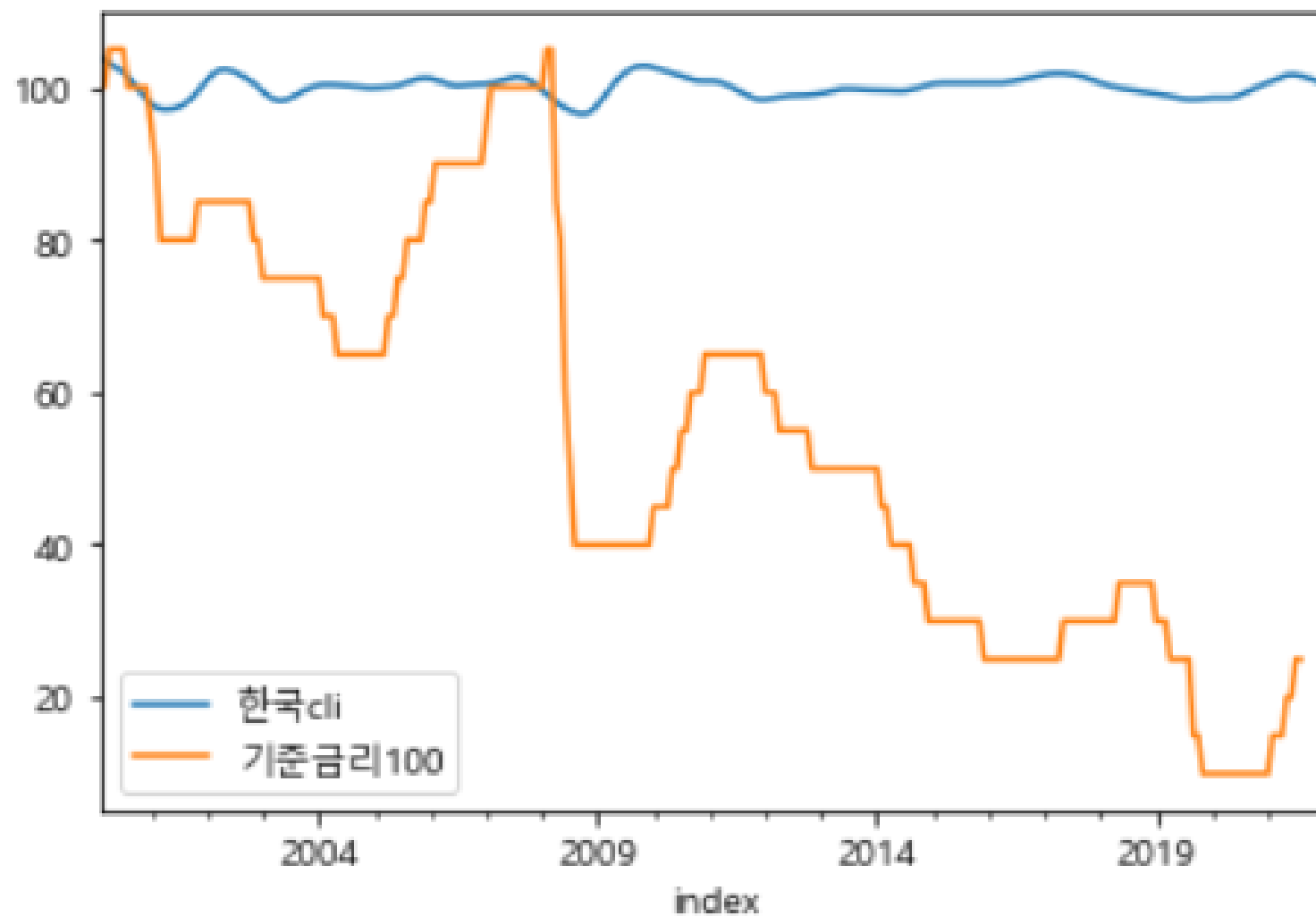
	기준금리	국채1	국채3	미국금리	한국cli	미국cli	year	month
338	1.25	1.586	2.369	0.375	100.2051	100.0927	2022	3

y_preds

array([0.7908695])

```
df_ir[['한국cli', '기준금리100']].plot()
```

<AxesSubplot: xlabel='index'>



경기 선행지수 산정방식 파악후
새로운 지표 들을 선정하여
인덱스화를 통해 시그널을 만들 예정

https://www.oecd-ilibrary.org/economics/composite-leading-indicator-cli/indicator/english_4a174487-en?parentId=http%3A%2F%2Finstance.metastore.ingenta.com%2Fcontent%2Fthematicgrouping%2F0f3ff737-en

2022 04/26 주식팀 업무 브리핑

업무 내용	강호 - FN_space결제후 유료데이터 코스피종목기준 수집완료 , 성공 홍정,민형-시가총액 코스피전종목 일별로 데이터 수집후 가공처리, 성공 (코스닥+) 포트폴리오 수익률 관련 공부 승희님, 전체 재무제표 가공 및 수정 데이터프레임 화 완료.
결과	코스피 기준 전체 재무제표 거의 가공완료. (조금의 보완과정 필요)
미비점 및 피드백 사항	민형님 코딩 극뽕 just do it 우려했던 데이터 수집및 가공 수월하게 가져오고 있는중. 포트폴리오 관련해서 종목선정 방식과 수익률 분석을 위해 개인적인 추가공부가 필요합니다.
내일 업무 내용	데이터프레임 추가가공, 포트폴리오 종목 선정 방식 세분화 그리고 기준점 잡기 (연도별) 1.시가총액가중방식 2.동일가중방식 3.누적초과수익률 4.동일가중조정수익률 5.규모조정수익률



FINAL PROJECT
