

PROJECT C+E

너에게 모든  
것을 바칩니다.  
최마정애.

# FINAL PROJECT



11차 회의 - 업무 브리핑



업무 브리핑



기타 논의

2022 05/04 비주식팀 업무 브리핑

업무 내용/  
결과

cli와 기준금리 관계 분석 : cli 전환점(확장→둔화) 이후 금리가 올라가는 패턴(평균적으로)  
즉 경기 확장 국면에서 둔화 국면의 전환점 이후 주식 비중을 줄이고 단기 채권으로 자금을 운용하면서 기준금리의 추이를 확인하는 전략이 유효할듯

만기수익률 개념 확립: 만기수익률은 채권 수익률과 같은 개념 (채권가격에 따른 연 이자율)  
채권 수익률 계산 알고리즘 : 데이터 날짜 기준으로 채권 매수 가정→ 만기일 까지의 날짜 계산하여 3월 주기의 이자 지급 계산 → 만기일까지 이자지급횟수\*주기당이자율 → 만기보유시 총 수익률  
채권 투자 전략 개념 공부 : 만기보유, 수익률 곡선타기, babell/bullet 전략

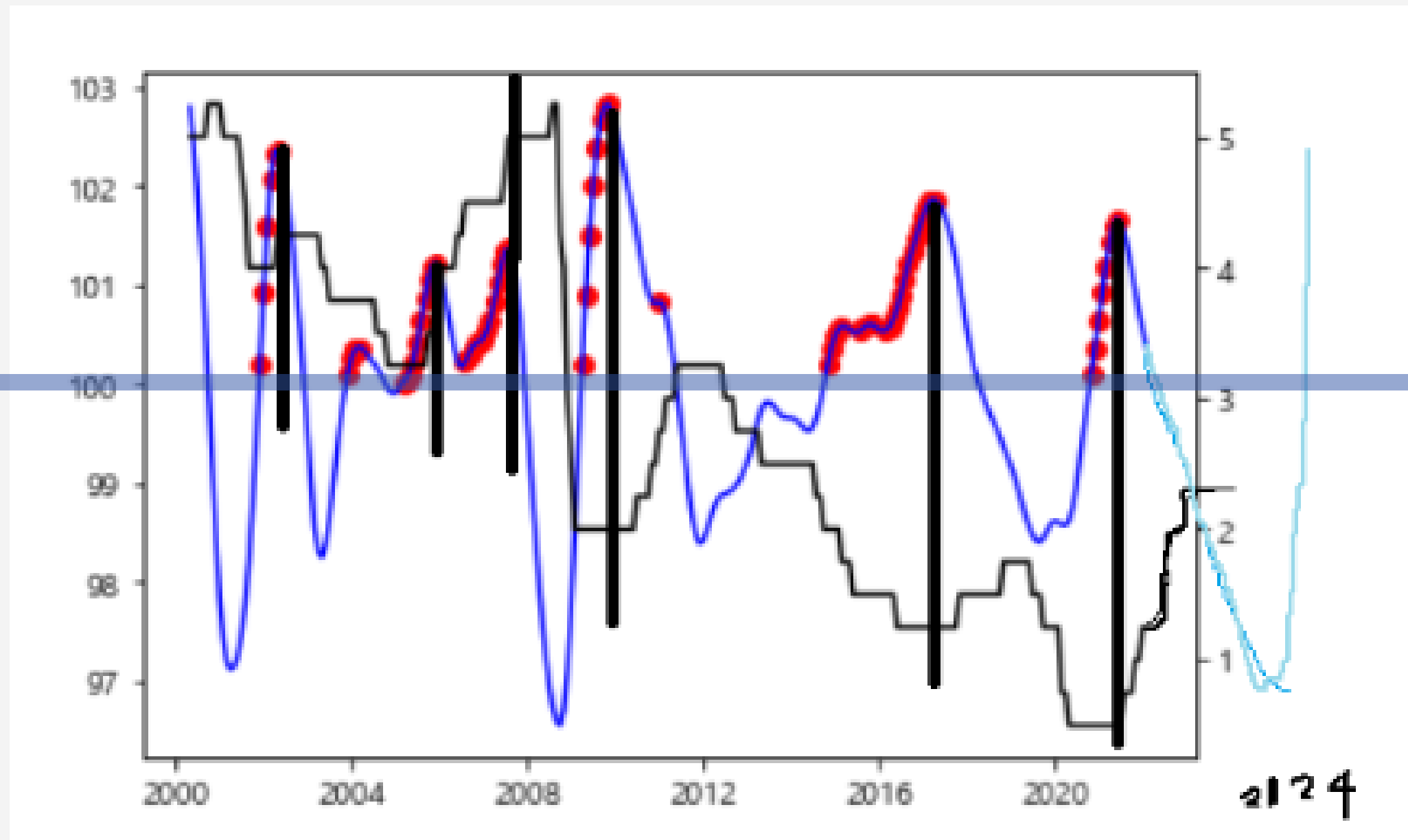
결론 : 보통 채권 투자 전략은 수익률의 증가/감소 예상으로 채권 비중을 늘리고 줄이는 흐름을 가지고 있음. cli로 기준금리 정점/상승/하락 추세를 어느정도 미리 확인할 수 있기때문에 그에 따라서 채권 비중을 늘리고 줄이는 전략을 짜면 될듯

미비점  
및  
피드백 사항

채권 가격 추이를 반영하려면 어떻게 해야할까... 잔존만기를 일자별로 컬럼 추가하여 그 일자와 일치하는 채권의 가격을 확인하면 될려나..  
주식 or 거시경제 부분에서 모델링을 살짝 섞어보는 것은 어떨지 < 인공지능 퀀트 책 참고>  
실시간 데이터 활용 웹 구현은 힘들 듯. 수집 데이터 DB에 넣고 정적으로 구현해야할듯. <추세전환 기간도 길고/ 데이터 수집 자동화가 안돼서>

내일 업무 내용

장/단기채와 중기채의 수익률 추이 분석<bullet/babell전략>  
채권 투자전략 코드 구현하기...!!!!!!



cli 정점<경기 확장>에서 둔화로 추세 전환시 금리가 오르는 경향 <기간의 차이는 있음>  
 이 시기를 기준으로 단기채 비중을 높이고 장기채 비중을 줄이는 채권 수익률 예측 전략 활용하면 좋을 듯  
 그리고 금리가 오르다가 100이하(불황기)에 진입했을때, 금리가 더이상 오르지 않는 패턴도 발견

## 2022 05/03 주식팀 업무 브리핑

업무 내용 / 결과	<p>1.민형,승희,홍정 - 딥처시 분기 재무제표 csv 파일 가져오기 완료. 연간데이터 가공한것 처럼 목요일까지 가공 완료 해보는것으로 오늘부터 연료주입중.</p> <p>2. 수익률 함수 가공 진행중(강호) 재무비율 한요소의 한연도를 대입해서 수익률 산출까지 해보는것 완료 -&gt; 재무비율 요소마다 전체 연도마다 수익을 나타내는것 목표로 진행중입니다.</p>
미비점 및 피드백 사항	<p>데이터 수집하는거 너무 고생하셨습니다!!! 수익률 산출 완벽하게 되면 분기데이터 또한 그대로 사용 가능하게 조금의 수정만 가해주면 되니 다음주에 기술적 지표 바로 들어갈수있게 함수와데이터가공 최대한 빨리 해보겠습니다.</p> <p>변경사항 코스닥 수집및 가공 -&gt; 코스피 분기 데이터 데이터 수집 및 가공으로 변경</p>
내일 업무 내용	<p>5/5일 어린이날 기념 10시 교육장 입소 수익률 함수 완료하기 데이터 가공 완료하기</p>

컨트롤 엔터 파이팅!!





**FINAL PROJECT**