

PROJECT C+E

너에게 모든
것을 바칩니다.
최마정애.

FINAL PROJECT



4차 회의 - 업무 브리핑



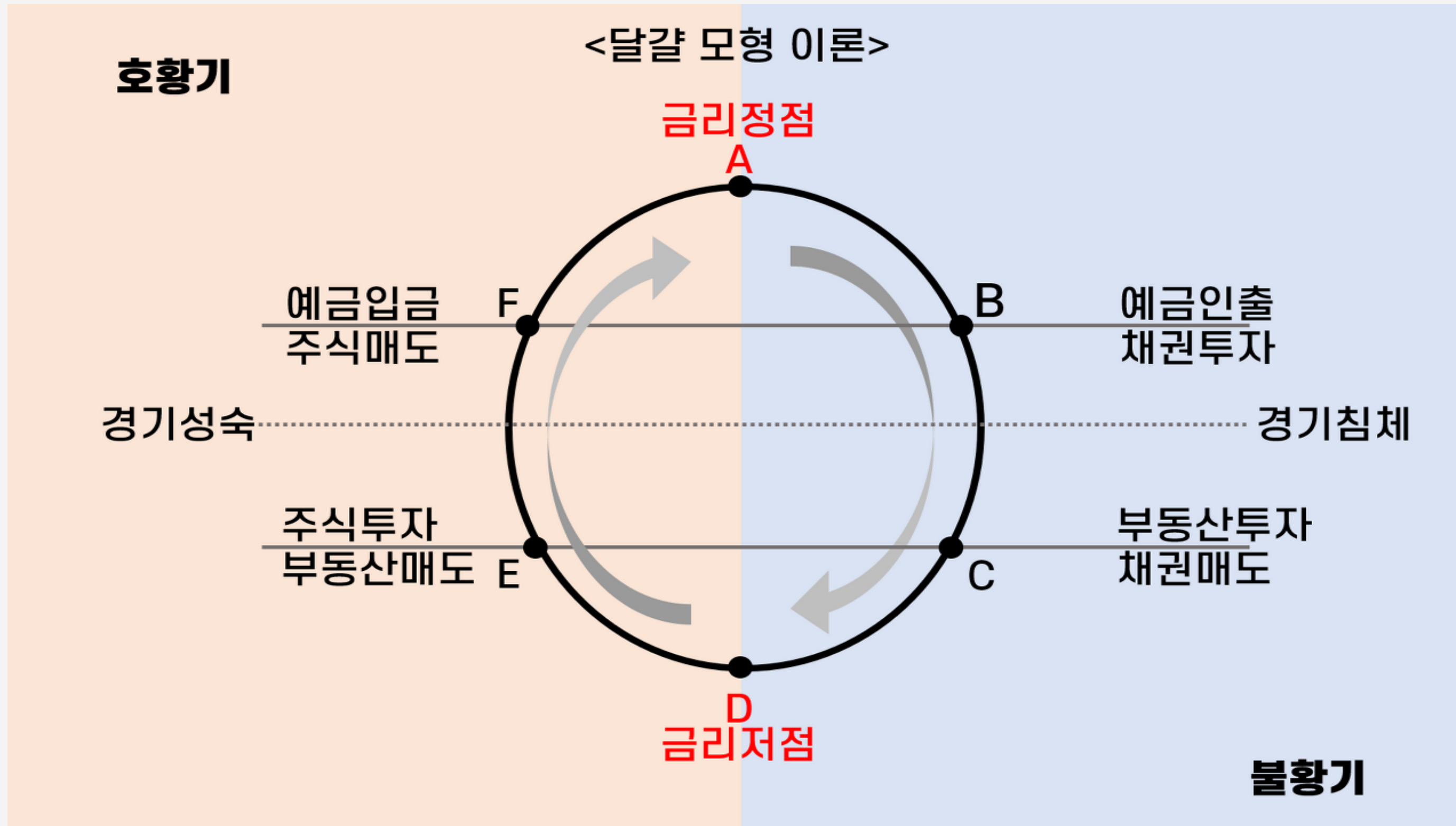
업무 브리핑



기타 논의

2022 04/25 비주식팀 업무 브리핑

업무 내용	군집화된 경기/금리 추세에 따라 미국 금리, 부동산 지수 등 디테일하게 비교 금리 인하 추세인데 KOSPI 수익률이 낮아진 월 기준으로 디테일한 분석 → 2008년 리먼브라더스 사태의 경우 미국 증시로 자금이 유출되어 금리 인하임에도 불구하고 수익률이 낮아지는 현상 → 부동산 호황으로 주식 자금이 부동산 시장으로 유입되어 국내 증시가 하락하는 현상
결과	전체적인 추세에 따른 주가 수익률은 달걀이론에 맞지만, 월별로 디테일하게 분석을 해보면 다른 피쳐의 영향을 어느정도 받는다는 결론 → 이론과 상반된 월별 추세를 원인분석하여 추가할 피쳐선정 + 시그널 지표 기준 피쳐 선정해야할듯
미비점 및 피드백 사항	부동산/미국증시등 다른 피쳐들의 영향도를 분석하는 과정이 필요 (디테일) NLP, 다른 피쳐를 활용하여 금리인상/인하 시그널을 만들어서 투자 기준점을 잡는 것이 필요할듯 거시경제 디테일적인 부분을 분석하는 과정은 많은 시간이 소요될 것이라고 생각됨
내일 업무 내용	군집화를 통해 거시경제 지표를 활용하여 금리/경기 추세를 분류했고, 달걀이론이 유효함을 확인 디테일 작업은 추후에 진행하는게 합리적이라고 판단 → 부동산(리츠), 채권 전략 구현 및 분석에 집중할 예정



비주식팀 업무 브리핑



	기준금리	CD	무담보콜금리	국채1	국채3	국채5	국채10	산업생산지수	환율	T/Bill(6M)	T/Note(5년)	T/Note(10년)	미국금리	수익률	label	수익률
index																
2000-10-01	5.25	7.04	5.36	7.13	7.84	8.19	8.25	50.2	1127.31	6.398	5.807	5.751	6.50	-0.161019	1	-0.161019
2000-11-01	5.25	6.99	5.38	6.96	7.31	7.56	7.86	49.5	1151.15	6.171	5.427	5.468	6.50	-0.010204	1	-0.171223
2000-12-01	5.25	6.89	5.39	6.67	6.79	6.92	7.18	48.7	1214.40	5.705	4.976	5.112	6.50	-0.009053	1	-0.180276
2001-01-01	5.25	6.43	5.32	6.04	5.99	6.20	6.65	48.2	1272.82	4.812	4.768	5.114	5.50	0.224506	1	0.044229
2001-02-01	5.00	5.73	5.13	5.51	5.43	5.76	6.41	48.7	1252.44	4.695	4.656	4.896	5.50	-0.064427	1	-0.020198
2001-03-01	5.00	5.68	5.03	5.81	5.84	6.40	7.00	49.0	1288.43	4.132	4.557	4.917	5.00	-0.094932	1	-0.115129
2001-04-01	5.00	5.84	5.01	6.20	6.59	7.24	7.74	49.4	1325.55	3.952	4.886	5.338	4.50	0.103475	1	-0.011655
2001-05-01	5.00	5.85	5.02	6.10	6.46	7.05	7.58	49.8	1298.46	3.565	4.914	5.381	4.00	0.060274	1	0.048620
2001-06-01	5.00	5.85	5.02	5.80	6.04	6.49	7.14	49.9	1293.83	3.648	4.950	5.412	3.75	-0.027820	1	-0.020800
2001-07-01	4.75	5.32	4.81	5.47	5.75	6.17	6.83	48.9	1302.60	3.460	4.526	5.054	3.75	-0.090031	1	-0.069230
2001-08-01	4.50	4.92	4.60	5.05	5.15	5.43	6.29	50.1	1285.39	3.291	4.380	4.832	3.50	0.006574	1	-0.062657
2001-09-01	4.00	4.66	4.33	4.75	4.89	5.21	6.19	50.1	1293.70	2.354	3.804	4.588	3.00	-0.120031	1	-0.182688
2001-10-01	4.00	4.36	4.02	4.42	4.74	5.65	6.54	50.4	1302.60	1.940	3.475	4.232	2.50	0.121185	1	-0.061503
2001-11-01	4.00	4.53	4.03	4.88	5.34	6.20	6.88	50.7	1284.00	1.743	4.064	4.752	2.00	0.197244	1	0.135742
2001-12-01	4.00	4.84	4.01	5.34	5.93	6.66	7.01	49.4	1289.66	1.795	4.302	5.051	1.75	0.077358	1	0.213100
2002-01-01	4.00	4.79	3.99	5.23	6.08	6.85	7.10	51.0	1317.60	1.909	4.371	5.033	1.75	0.078377	1	0.291477
2002-02-01	4.00	4.54	4.02	4.96	5.92	6.66	7.00	52.0	1318.72	1.867	4.191	4.877	1.75	0.096141	1	0.387617
2002-03-01	4.00	4.64	4.03	5.26	6.30	6.97	7.17	53.3	1322.51	2.094	4.805	5.396	1.75	0.092184	1	0.479801
2002-04-01	4.00	4.79	4.03	5.42	6.47	7.06	7.30	53.7	1318.93	1.893	4.405	5.085	1.75	-0.059448	1	0.420354
2002-05-01	4.25	4.81	4.26	5.42	6.30	6.80	7.09	53.1	1266.06	1.883	4.353	5.043	1.75	-0.054539	1	0.365815

금리 인하 기조

주식 수익률 저하

결과적으로
수익 증가 (40%)

2022 04/25 주식팀 업무 브리핑

업무 내용	데이터 수집 단계 : 포트폴리오 수익률을 구하기전 코스피를 기준으로 재무재표 데이터를 가져오는 업무 동일분담.
결과	코스피 기준 현재상장종목 813 개중 몇개를 제외하고 당일 작업 완료 가능
미비점 및 피드백 사항	단순 반복 업무라 팀원들이 고생을 많이 하셨습니다. 점진적 프로세스를 거쳐서 코스피 한정 우리의 목표를 완료한 후 코스닥 까지 진행하게 될 때 효율적인 단순 업무 시간을 배분하는것이 좋을 것 같습니다.
내일 업무 내용	데이터 합치기 ,코스피종목기준 종가데이터 수집, 재무제표 관련 부족한 데이터 확인 및 추가 수집 업무 예정



FINAL PROJECT
