

PROJECT C+E

너에게 모든
것을 바칩니다.
최마정애.

FINAL PROJECT



16차 회의 - 업무 브리핑



업무 브리핑



기타 논의

2022 05/12 비주식팀 업무 브리핑

업무 내용/
결과

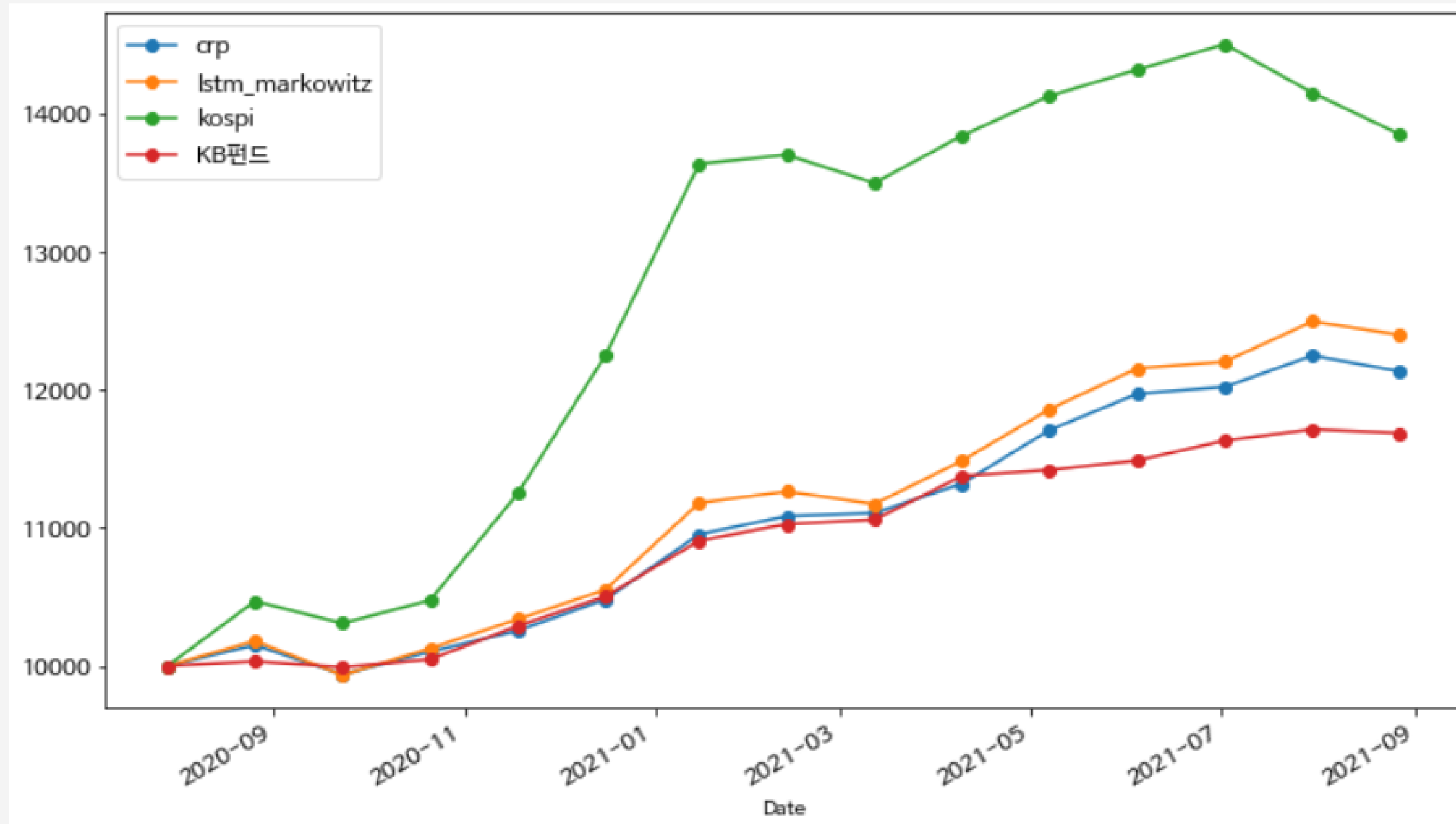
상현 : LSTM Train 데이터 기간별로 슬라이싱 하여 학습하는 코드 구현 (원래는 기간 텀이 있어도 이어서 학습함)
승우 : LSTM 모델링 및 튜닝
⇒ LSTM 기간별로 슬라이싱하여 학습하는 것이 모델 성능이 더 좋았음 / 거의 모든 구간에서 학습이 잘 이루어짐
⇒ Kb 펀드와 수익률 비교 완료

미비점
및
피드백 사항

상승 / 하강 2개의 국면에 따라 모델을 달리하는데
상승 모델에서는 Gamma값을 낮게 조정하고 하강 모델에서는 Gamma값을 높게 조정하여 수익과 리스크의 균형을 맞춰야할 듯
(상승 모델에 높은 Gamma값은 상승장에서 별로 수익을 못봄)

내일 업무 내용

오늘 LSTM 기간별 가중치 산정 예정 → DF화 후 기간에 따른 주식 비중 * 주식팀 전략 수익률을 곱하면 포트폴리오 수익률 구할 수 있을 듯



KB 밸류 초이스 30 혼합형 펀드 수익률과 비교

2022 05/12 주식팀 업무 브리핑

업무 내용/
결과

200 일선 지표 기준 매수 매도 시그널 및 수익률 종목하나 받아오게끔
확인 $\pi\pi$
여러개 한번에 태워서 다양한 지표들 데이터 프레임화 해보겠습니다
이거 되면 다른 기술적지표는 매우 빠르게 가능합니다.

결과 - 백트레이딩 심화구간 진입
열심히하겠습니다!

미비점
및
피드백 사항

없습니다.

내일 업무 내용

백테스팅 분석 데이터 프레임화 및 지표 추가

컨트롤 엔터 파이팅!!





FINAL PROJECT
