220426 5차 회의

<비주식팀 : 거시경제 분석>

머신러닝을 통해 미래 금리 예측 모델을 구축 시도.(ARIMA, 회귀분석)

하지만, 예측이 제대로 구현되지 않은 결과물을 출력.

새롭게 채권 전략을 마련하기 위해, 거시경제 추세에 따른 전략이 나누어져 있어 거시경제 분석에 집중. 경기선행지수라는 지표를 활용하여 금리가 후행하는 성격을 발견.

경기선행지수를 쓴다기보단, 구성하고 있는 지표에 주목하여 새로운 경기선행 지표를 직접 구성해보는 방안을 생각.

인덱스화 한 자체시그널을 개발하여 매수타이밍과 매도타이밍을 잡을 예정.

<주식팀>

필요한 데이터를 추려서 전처리, 가공, 성공.

추가 데이터는 FN\_SPACE 데이터 결제 후, 유료데이터 수집완료, 성공.

우려했던 데이터 수집및 가공 수월하게 가져오고 있는 중.

데이터프레임 추가 가공이 필요.

코스피 시가총액과 종가 데이터 가져오기는 성공.

재무제표 데이터는 전부 끌어모았다고 보면 됨. → DB에 넣어야될 필요.

데이터 프레임 추가 가공 여부가 필요.

수익률 산출 방식

1. 시가총액
2. 동일가중
3. 누적초과
4. 동일가중조정
5. 규모조정

논문 베이스 : 피터-린치, 워렌 버핏, 그레이엄을 기반으로 논문 베이스로 수익률을 산출할 예정. or 대형주 소형주 기준, 안정성 재무비율 기준으로 상위 기업 리스트해서 보여주기.

(다른 논문 참고해서 생각해 볼 예정.)

수익률 확인 시, 기준금리 기간을 통해 기간 선정을 하는 방법을 생각. ex. 고금리 저금리