220427 6차 회의록

<비주식팀>

do :

데이터 셋 예시 작성 완료. – 강사님에게 브리핑해서 승인 받음.

금리 선행지수 관련해서 시그널 만들기 - 가이드라인 찾음(벤치마킹 해볼 예정)

시그널 만들기 – 경기선행지수를 이용하여 시그널 만듦. 미국과 한국 경기선행지수의 격차를 이용하여 금리의 방향성을 예측하기로 함.

고도화하기 위해 찾은 가이드라인을 통해 세부 전략과 세부 지표를 다시 만들어 볼 예정.

모멘텀 등 기술지표를 활용해 경기 국면을 분류할 수 방법을 찾아, 시그널을 고도화할 예정.

채권 데이터 수집 방안 모색 – API 주소까지 확보 (함수만 만들면 됨), 딥서치 api도 활용해볼

예정. 딥서치가 시세 제공을 하지 않아, 공공데이터 api를 활용할 예정.

경기국면을 4개의 국면으로 나누어 포트폴리오 자산 비중을 조절하여 최적 수익률이 나오는 포트폴리오를 산출할 예정.

To do :

내일은 하루 종일 뉴스 크롤링 데이터를 수집해볼 예정.

함수를 통해 키워드 가져오는 식으로 구상 중.

<주식팀>

do :

포트폴리오 종목 수 결정. – 선정완료.

보통의 포트폴리오에서는 30-70개 정도의 종목을 선정.

but, 우리 프로젝트의 타겟은 개인투자자이기 때문에, 기관이 운용하는 포트폴리오 종목 수와는 차별화가 필요하다고 생각. → 줄이는 쪽으로. (5개, 10개, 50개 종목)

재무요소 비율 기준을 점수화 하는 선택조건이 없는 것들을 찾아오기.

논문을 참고하여 세부 지표를 더 넣을 예정.

민형 - 배당, 시장가치

강호 - 생산성, 레버리지

홍정 - 유동성, 활동성

승희 - 성장성, 수익성

수익률 계산 : 시가총액 가중방식, 동일균등방식을 사용해볼 예정.

종목을 선정하고, 수익률을 계산하는 가짓수는 6개정도가 나올 예정.

* 재무지표가 8개가 되기 때문에, 8\*6 = 48개의 포트폴리오 비중이 나옴.

몬테카를로 계산법을 이용해 최적 포트폴리오를 찾아보자!

To do :

데이터 가공처리를 범주화하여 가공하는 업무가 필요할 듯.

종목 선정하는 함수 짜기.