220503 회의록

<비주식팀>

채권 자체가 거래량 데이터가 없고, 장외거래 데이터를 구하기가 어려웠기 때문에 채권가격이나 수익률의 유의미한 판단이 어렵다고 판단. → 채권지수 신용평가 사이트에서 제공해주는 채권별 지수 데이터를 수집. 회사채 등급별 평균 이율, 만기일 등 더 필요성있는 데이터가 많았기에 데이터 교체 성공적이라 판단

(koreaap.com)

거시경제 지표에 채권을 비교한 결과 금리와 채권은 (-)음의 관계. 금리와 채권의 표면이율은 같은 방향으로 가는 것을 확인할 수 있었음. 고로, 변동성이 있는 추세에서는 금리가 올라가는 시점에서는 채권쪽에 투자비중을 늘리는 방안을 생각.

새로 가져온 데이터에서는 채권등급별에 따라 어느 기업의 회사채를 사라기보단, 회사채 등급의 추천을 해주는 형식으로 진행할 예정.

To do :

채권 수익률 계산 방안 수립 및 계산 함수 코드 구현

경기 4국면 중, 둔화, 축소와 관련된 국면에 채권투자 시 어느정도의 수익률을 볼 수 있는지 계산해볼 예정.

Duration, Convexity, Sharp ratio 등. 전문적인 채권용어의 숙지가 필요하다고 봄.

강사님 조언 : CLI 는 변동성추세전략이기 때문에, 횡보구간에서 적용될만한 새로운 거시경제지표를 파악하여 박스권의 upper, lower를 파악해서 돌파 시 혹은 횡보 시 필요한 투자전략을 따로 세울 필요성이 있다고 판단.

→ 횡보구간을 정확히 잡는 시그널을 잡으면 거의 70% 완료 예상.

<주식팀>

재무비율 요소 함수 완성.

성장성, 수익성 종목선정 기준점수를 바꿨음. bec, ecos기준으로 세워둔 기준점보다 너무 높아서 종목선정이 제대로 안되는 문제점 발견.

문제점 해결 → 재무비율요소별 종목 선정을 완료. 유의미한 결과 확인.

코스피 연도별 데이터를 넘어서 분기별 데이터 모으는 중.

종목선정 함수 초안 완료, 수익률 함수 짜는중

수익률 함수 짜기 전, 종목명을 종목코드로 바꿔 실적발표일이 제일 늦은 날짜 호출하는 과정까지 진행중.

연도별 재무비율 리밸런싱을 목표로 했으나, 확실치않은 결과물이 나올수 있다는 것에 대한 우려로,

분기별(6개월별) 리밸런싱을 다시 목표로 삼음.

포트폴리오

에서도 주식비중은 계속 변하는 경우가 많음.

리밸런싱 주기는 6개월로 잡되, 그 기간 속에서 기술적 지표를 통해서 매수 매도를 통해 종목별 비중을 변화. 리밸런싱 시기에는 기본적 지표를 통해서 포트폴리오에서 종목을 뺄지 그대로 유지할지를 결정.

→ Good!

To do :

수익률 함수 가공 계속 진행 및 완료를 목표

코스피 분기 재무제표 데이터 가공에 들어가서 최대한 빠르게 완료하는 것을 목표.