20220504 회의록

<비주식팀>

채권의 전략 구현 코드는 내일 할 예정.

먼저, 채권 전략 중 소극적 투자전략 - 만기보유전략, 적극적 투자전략 - 수익률 곡선타기, babell/bullet

보통 채권 투자 전략은 수익률의 증가/감소 예상으로 채권 비중을 늘리고 줄이는 흐름을 가지고 있음. cli로 기준금리 정점/상승/하락 추세를 어느정도 미리 확인할 수 있기에 그에 따른 채권 비중 변화전략.

채권 가격 추이를 반영하기 위한 고민 중…

잔존만기를 일자별로 컬럼 추가하여 그 일자와 일치하는 채권의 가격을 확인할 지..

주식 or 거시경제 부분에서 모델링을 살짝 섞어보는 것이 좋다고 생각<퀀트 책 참고>

실시간 데이터 활용 웹 구현은 힘들 듯. 수집 데이터 DB에 넣고 정적으로 구현하는 형식으로

bec. 추세전환 기간도 길고, 데이터 수집 자동화가 안되기에 (수동으로 csv 저장)

시그널의 경우, cli 지수가 100기준으로 위면 호황, 아래면 불황으로 판단.

고려해볼 점은 선반영됐다고 판단해서 해야할 듯.

채권투자, 주식투자 관련 용어 : <https://securities.miraeasset.com/imf/300/imf201.do>

<주식팀>

딥서치 분기 재무제표 csv 파일 가져오기 완료.

연간데이터 가공한 것처럼 분기데이터 가공 시작.

수익률 함수 짜는 거 진행중.

재무비율 지표를 연도별로 대입해서 수익률 산출까지 해보기.

재무비율 요소를 전체 연도별로 수익률을 나타내볼 예정.

함수 수익률 : 연도별 재무제표 발표일 다음날에 매수하는 식으로 진행할 예정.