220506 회의록

<비주식팀>

회사채 단기, 중기, 장기 데이터 분석완료.

lstm 딥러닝을 통한 채권 데이터 비중 계산해볼 예정.

강의 영상에서 수익률을 활용하여 지수 데이터를 구성해본 걸 확인했기에,

주말동안 강의를 통해 딥러닝에 대한 전반적인 지식을 정리해보고,

필요한 지표를 만드는 걸 고려해봐야 함.

포트폴리오 이론 : 자산별 수익률과 표준편차를 투자자 위험성향에 따라 제공해주는 형태.

포트폴리오 최적화를 위해 효용과 위험조정수익률이 극대화되는 가중치를 찾아줄 필요가 있음.

알고리즘 : 마코비츠 함수 (loss function)를 통해 미래의 기대수익률과 투자위험을 계산.

채권, ETF, 금, Kospi를 학습시켜 전체 자산의 비중을 결정할 것.

→ 자산 비중이 생겨나면, 그 안의 세부전략은 주식팀의 현재 전략을 적용해볼 예정.

<주식팀>

재무제표 분기데이터 완료.(100%)

주식팀도 금리와 경기선행지수를 통해 주식의 최대수익률과 최대MDD 낙폭을 줄이는 기법을 파악해볼 예정.

국면별 매수매도 시점과 보유전략을 파악하는 것이 주식 투자 자산 비중의 세부전략을 짜는데 중요하다고 생각.

ex. 경기 침체기에는 주식 투자비중을 줄이고, 안정성 위주로 투자하는 기법을 파악.

분기데이터를 이용하면, 연도별로 포트폴리오를 짰을 때보다, 조금 더 세부적으로 포트폴리오 구성이 가능할 것이라 생각.

함수 태우면, 각 투자 기법별 (매수날짜, 매도날짜, 연별수익률, 누적수익률)을 비교해볼 수 있음.