220509 회의록

<비주식팀>

자산포트폴리오 LSTM 모델 학습을 시작.

→ 모든 데이터를 학습하여 튜닝한 결과 : 제대로 된 학습값이 나오지 않아서 방향성 바꿈.

→ CLI 경기국면을 2국면으로 분류하여 (상승 : 회복,확장), (하강 : 둔화, 위축) 진행.

→ 상승장에서는 코스피보다 높은 수익률, 하락장에서는 최대 MDD 최소화.

큰 틀로 봤을 때는 모델학습의 결과가 유의미했음.

다른 사람이 만든 코드를 인용했기 때문에, 직접 LSTM 모델을 만들어서 학습을 진행할 예정.

상승장의 경우, KOSPI 수익률보다 높은 수익률을 만들어 낼 수 있는 자산비중을 구성할 수 있었음.

하락장의 경우에도, KOSPI 수익률보다 높은 수익률을 만들어 낼 수 있었음.

MDD가 아니라, 수익률이 높아져서 추가로 튜닝해볼 예정.

포트폴리오 자산 유형

1. 단,중,장기채 로그수익률
2. 코스피 수익률
3. ywo로그
4. iau로그
5. dbc로그
6. vnq로그
7. nsd로그

<주식팀>

분기데이터셋으로 재무비율 구성완료. 분기별로 리밸런싱된 수익률 추이를 대략적으로 확인할 예정.

아직은 기간 설정이 국면이 섞인 상태에서 설정된 상태.

그러므로, 국면별 상세 기간을 구해서 디테일하게 상승,하강 국면별 백테스팅이 필요.

메인 논문의 기술적지표 배경 지식을 토대로 공부 및 이용방법 강구.

→ MoneyMoney 블로그 참조하면 좋을 듯.

ref : https://blog.naver.com/mymoneymoney

→ 백테스팅 라이브러리 선택 후 사용법 확인 – 백테스팅 실시 및 분석결과 도출

CLI랑 비교해서 추세별 패턴 비교 후, 국면별로 기술적 지표를 활용하여 백테스팅할 예정.

백테스팅 결과로 나타나는 수익률 차이를 고려하여 하락 구간에서 MDD의 낙폭을 최소화 할 수 있는지에 관해 상세하게 분석하는 것이 필요.

Keep Backtesting!!