

SOLIFACTION

누구나 나만의 펀드를 만들고 팔 수 있는
딥러닝 기반 탈중앙화 소셜퀀트플랫폼 서비스

IR_pitchdeck_2022.01

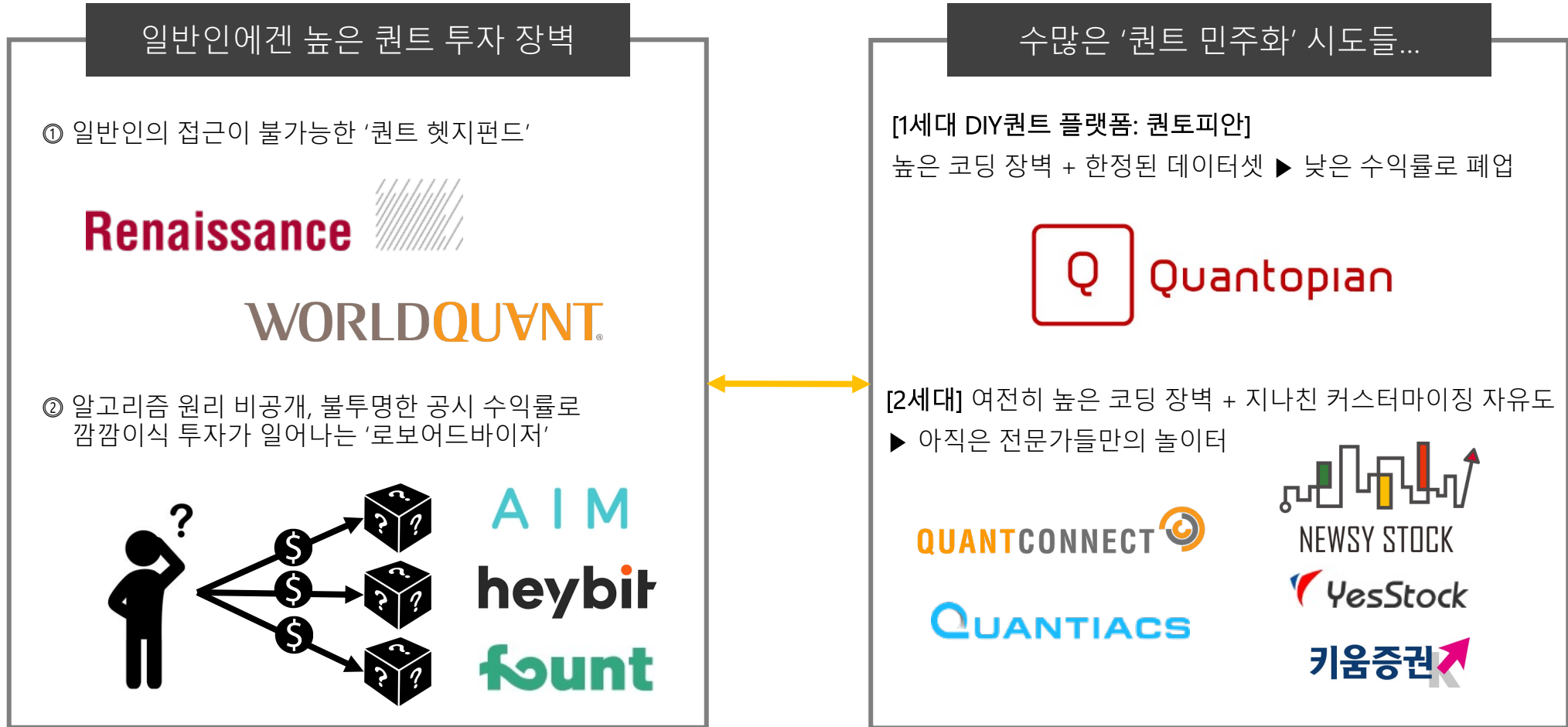


ALCHEMiLAB

Finance,
perfected
by science.

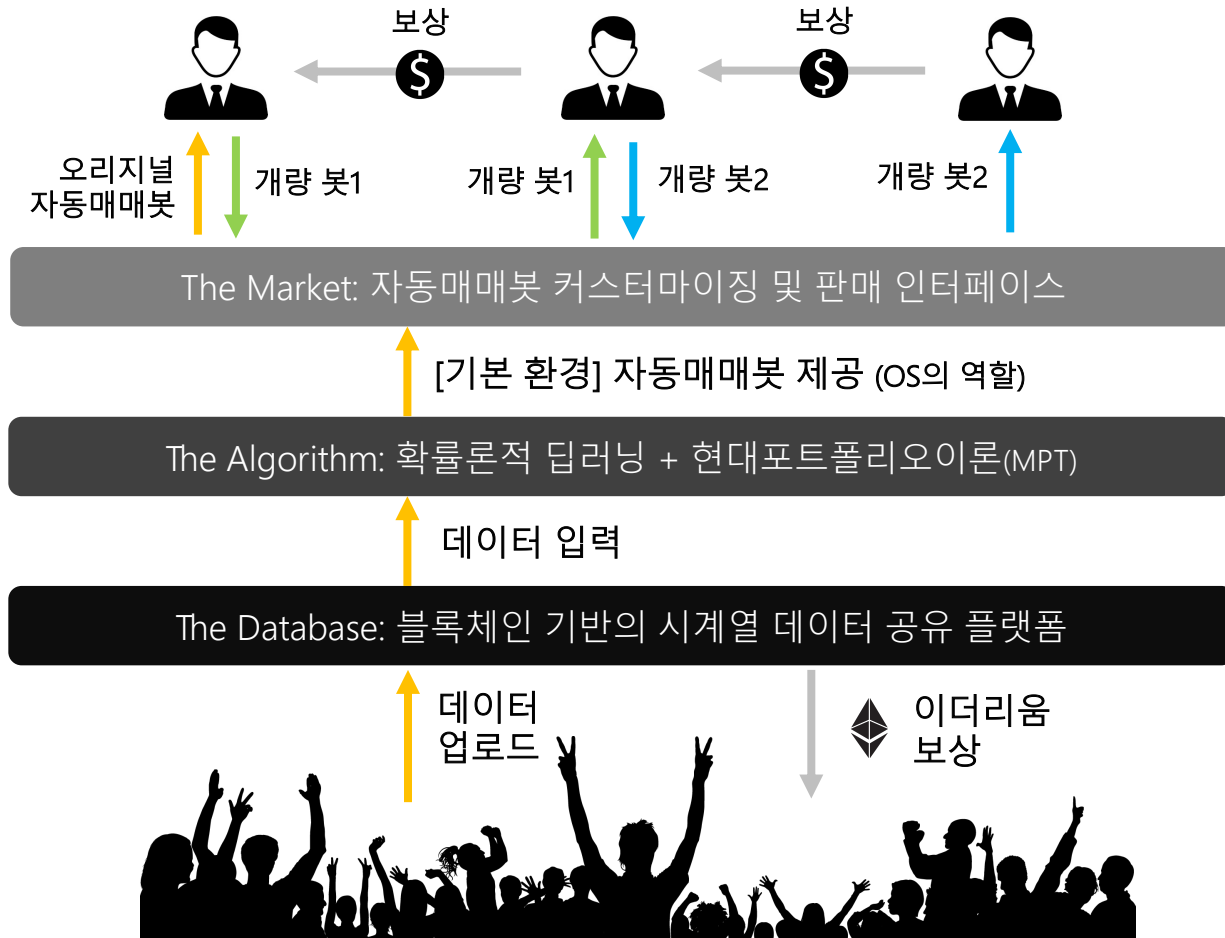
PROBLEM

일반인의 퀀트 투자는 **기존 로보어드바이저**의 불투명한 정보 공개 문제나 **DIY퀀트플랫폼**의 높은 코딩 장벽, 어려운 조작법, 낮은 수익률의 문제로 '쉬우면서 수익률 높은 퀀트 투자'가 이뤄지기 힘든 상황임



SOLUTION: 신개념 '귀납적 소셜퀀트플랫폼' 개발

유저에게 기본환경으로 자동매매봇(솔리팩션)을 제공해 코딩 장벽 해소 및 유저의 커스터마이징 가이드라인을 제공 후, 유저 각자 쉽게 개량 자동매매봇을 만들어 거래할 수 있는 소셜퀀트플랫폼으로 문제를 해결하고자 함



SOLUTION #1: 기본 봇 커스터마이징

- 솔리팩션 알고리즘의 커스터마이징을 통한 코딩 장벽 해소
- 마켓플레이스 제공을 통한 소셜 플랫폼 수요 증폭 (탈중앙화)



SOLUTION #2: 고수익 창출 강제 기능

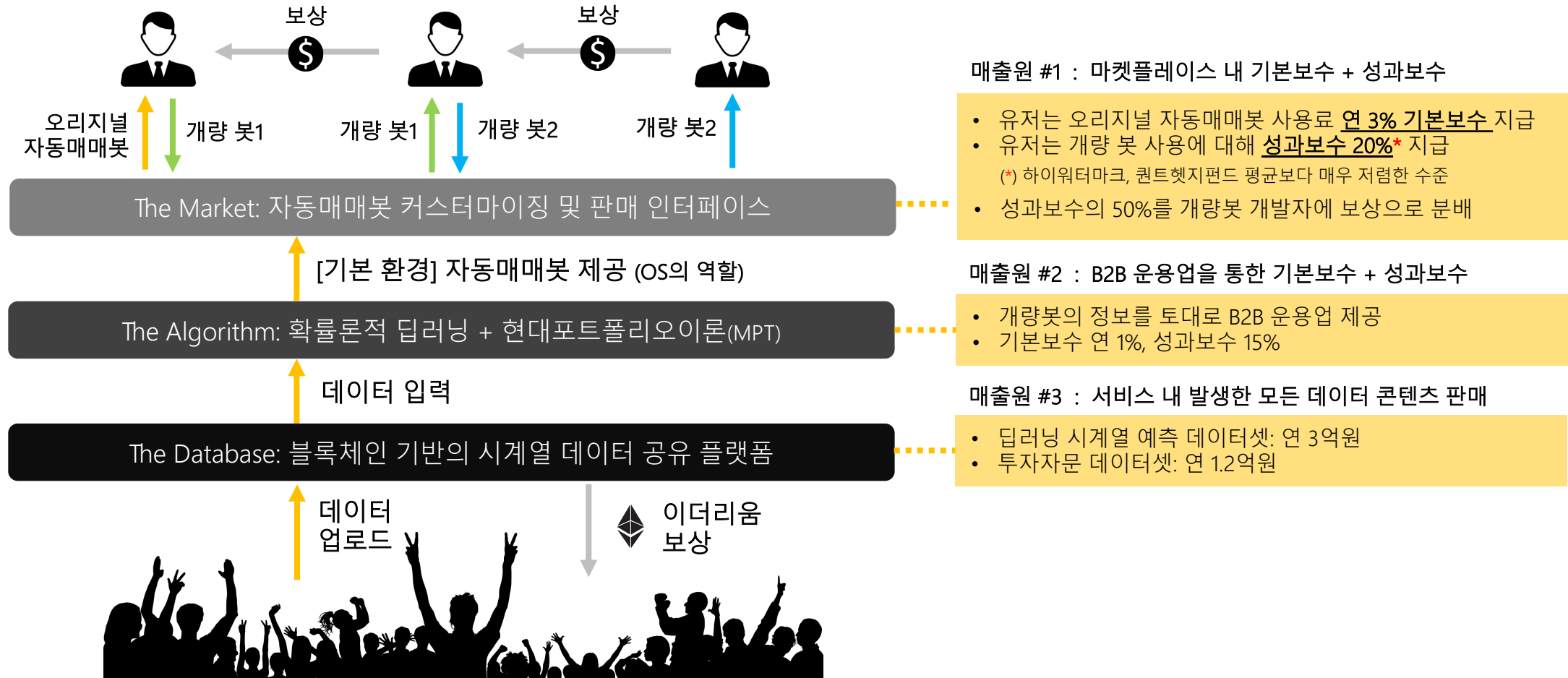
과학과 객관에 근거한 투명한 로보어드바이저 엔진이 유저 가이드라인을 제공하여 과도한 자유 제한

SOLUTION #3

소수 데이터사업자(MSCI, Barclays)의 독과점으로 인한 과도한 데이터 비용 절감 효과

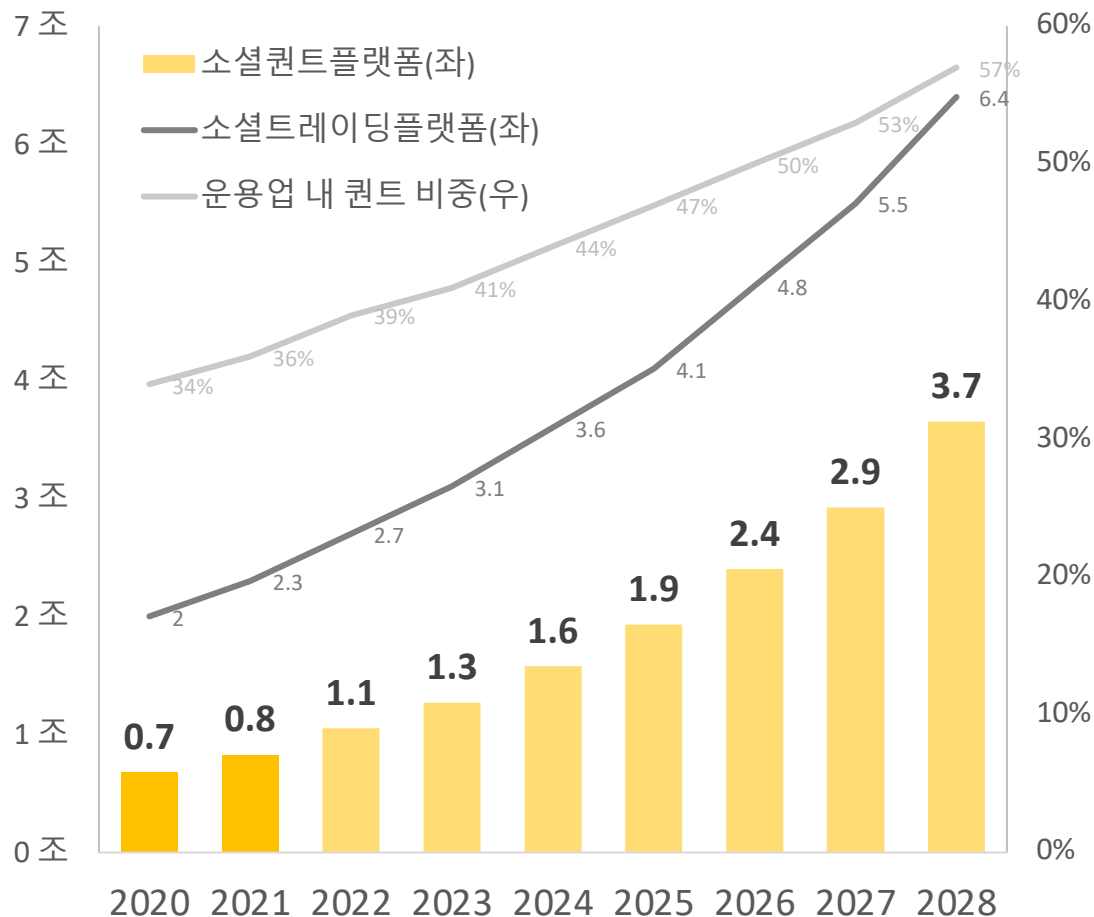
BIZ MODEL

플랫폼을 구성하는 각 시스템 레이어는 별도 상품화가 가능하여 매출원을 다각화할 수 있는 구조로 설계



MARKET SIZE

시장은 '글로벌 소셜퀀트플랫폼'으로 21년 기준 약 8,300억원으로 추산되며, 연 18.3%의 높은 성장세 예상됨.



$$X = \frac{\text{글로벌 소셜트레이딩플랫폼 시장 규모 (조원)}}{\text{글로벌 운용업 내 퀀트 시장 비중 (\%)}} \times \text{글로벌 소셜퀀트플랫폼 시장 규모 (조원)}$$

	소셜트레이딩 시장	운용 내 퀀트 비중
규모(2020년)	2조원	34%
CAGR	15.6%	6.6%
성장동력	<ul style="list-style-type: none"> • 모바일 시장 확대 • 브로커 해외 진출 	<ul style="list-style-type: none"> • AI 성능 개선 • 운용비용 절감 • 책임소재 규명 용이
출처	OMR Global Fortune Biz Insight	Economist

COMPETITIVE EDGE

- DIY퀀트플랫폼 경쟁사 대비 완전 자동화된 서비스 기반으로 유저의 퀀트 투자 장벽을 최소화함.
- 딥러닝 기반, 객관적 미래 예측 모형을 업계 최초로 도입하여 로보어드바이저 경쟁사 대비 높은 수익률은 시현 중임.

경쟁력 #1 : 업계최초 완전 자동화된 객관적 미래예측 모형* 도입 (*) MPT + 확률론적 딥러닝

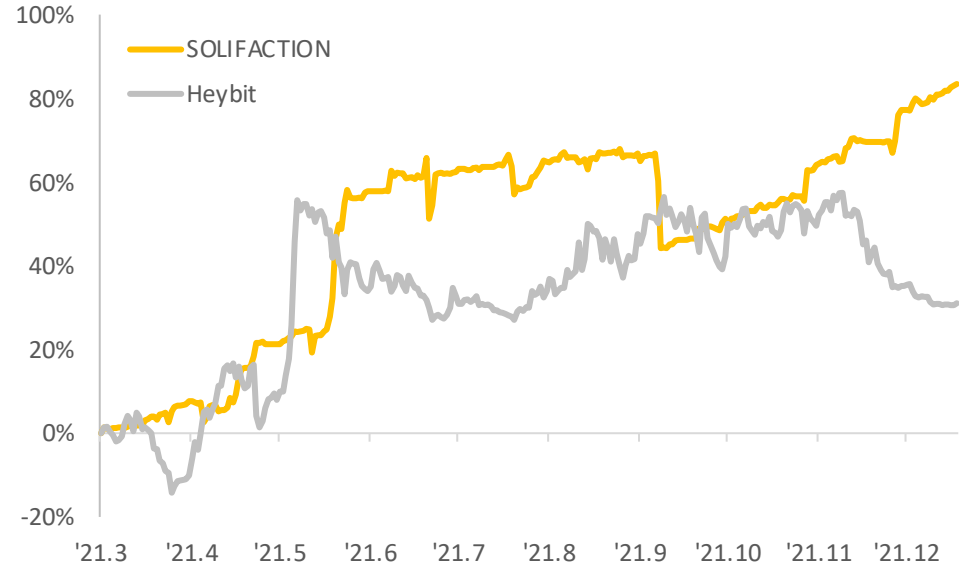
- 경쟁사(DIY퀀트플랫폼) 대비 완전 자동화로 일반인 유저의 높은 퀀트 투자 접근 장벽 해소
- 객관적 미래 예측 모형 도입으로 인해 해당 모형 기반 플랫폼화 가능

		IT 해결 가능 영역		딥러닝 해결 가능 영역		자동화 불가능 영역
퀀트에 요구되는 업무		백테스팅	코딩	자산배분	미래예측	매매 시점 포착
업무 의미		전략의 수익성 사전 검증	자동 매매 봇 개발	예측 결과 토대로 자산배분안 도출	주어진 데이터로 미래 예측	언제 사고 언제 팔지 결정
1세대	Quantopian					
	QuantConnect		Python IDE			
	에스스탁		YesLang IDE			
	키움 영웅문		조건식			
	뉴지스탁					
2세대	Numerai		Python IDE	MPT		
	ZOLBO		조건식	MPT	확률론적 딥러닝	
로보 어드바이저	Betterment			MPT	Factor Model	Factor Model
	에임			Factor Model	Factor Model	Factor Model
	블리오			Factor Model	Factor Model	Factor Model
	헤이비트			Factor Model	Factor Model	Factor Model
				Factor Model	Factor Model	Factor Model

현대포트폴리오이론(MPT)		팩터모델
자산배분	기대수익, 기대위험 입력 받음	기대수익, 기대위험과 전혀 무관한 '시그널 강도' 점수화해 활용
미래예측	매수/매도 포지션 방향 + 매수/매도 수량 정보 제공	Only 매수/매도 포지션 방향 제공
매매시점포착	예측 불가능의 영역	예측 불가능의 영역 ※ 단, 로보어드바이저 업체들이 과거 시뮬레이션에서 가장 좋은 성과 나온 시점을 억지로 끼워 맞춰 시장 왜곡

경쟁력 #2 : 경쟁사(로보어드바이저) 대비 높은 수익률 시현

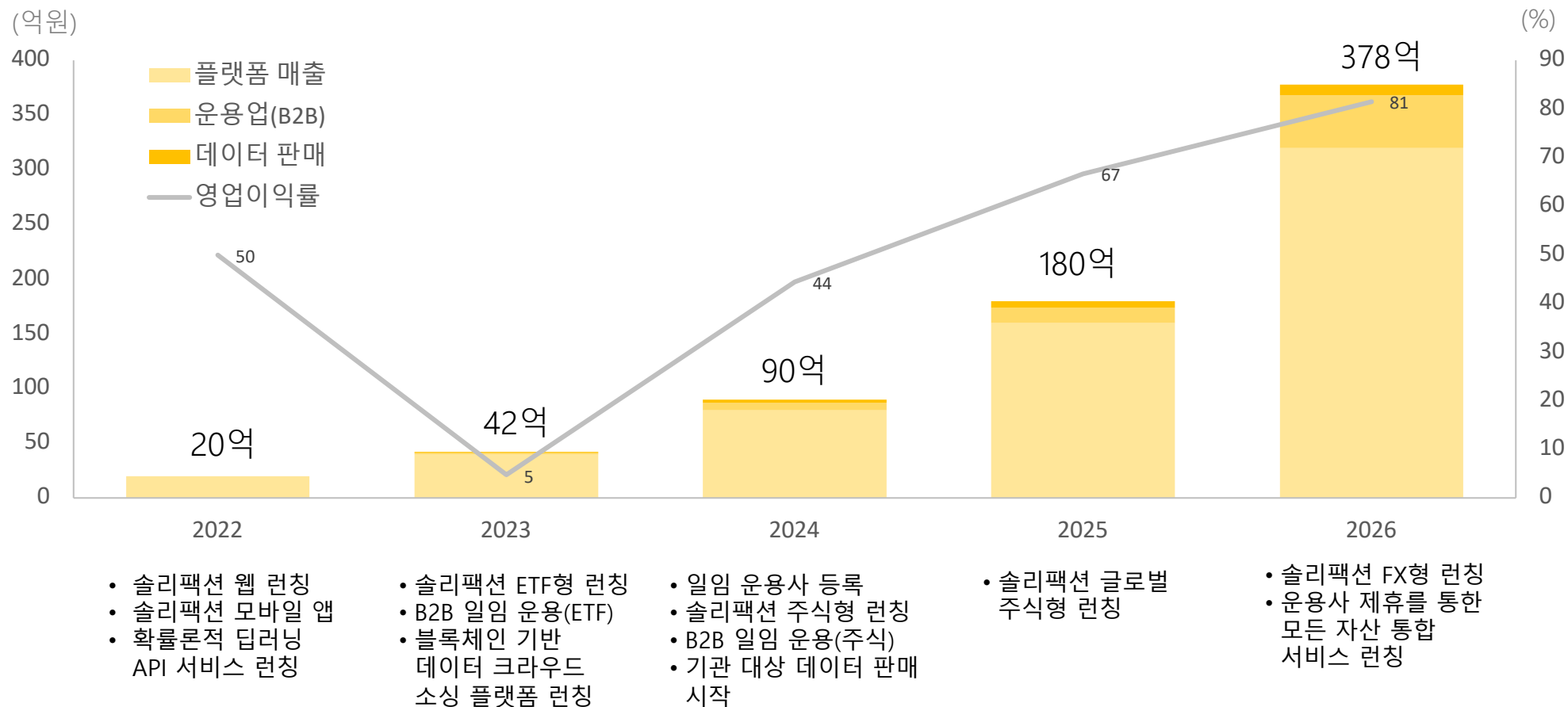
- 기초자산(가상자산)이 같은 헤이비트 수익률과 비교 시, 월등한 누적수익률 및 위험조정성과(위험 단위당 수익률)를 보임



위험지표	솔리팩션	헤이비트
누적수익률	83.42%	31.02%
Sharpe Ratio	3.4 배	1.7 배
Sortino Ratio	22.4%	8.5%
Max Drawdown	-14.09%	-18.42%

VISION & PROJECTION

- '22년 웹 기반 글로벌형 암호화폐 자동매매봇 출시 및 자체 앱 기반 소셜트레이딩플랫폼 출시 후, 기초자산 확대(ETF, 주식, FX)로 성장할 계획
- 운용 프로세스 완전 자동화 및 고객센터 운영비 최소화를 통해 향후 5년 평균 49.5%의 높은 영업이익률을 달성이 기대



TEAM & FUND ALLOCATION

- CEO의 전문성: 퀀트운용/퀀트 알고리즘 개발/딥러닝 개발/블록체인 개발
- 조달 자금의 절반을 서비스 고도화 개발에 활용

주요 팀 구성원

- 총 팀원 7명: 개발자 5명, 비개발자 2명



김한샘 CEO

- 딥러닝/블록체인 개발 (두나무, 피어테크)
- 퀀트 개발 (S&P, KG제로인, 두나무)
- 자산운용업 (미래에셋, 코레이트)
- 성균관대 경제학과 졸업



원형석 CTO

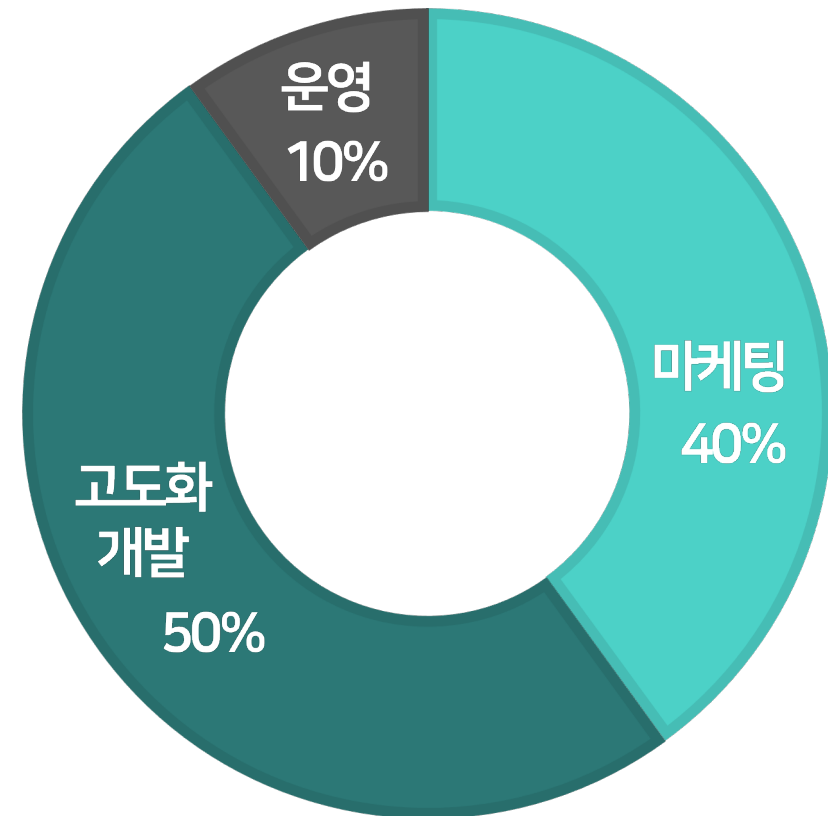
- UNIST 신경전산연구실 근무
- UNIST 물리학과, 컴퓨터공학과 졸업



이동훈 연구원

- 데이터 보안 솔루션 기업 FASOO 근무
- 뉴욕주립대 경영학과 졸업

자금사용계획



정보의 비대칭으로 쌓아 올린 기득권은
우리의 광산입니다.

우리는 IT기술로 이 광산을
채굴합니다.