

## 2023 년 전기 산학협력 프로젝트 멘토 의견서

## 1. 지도개요

팀 명	파라솔		
과 제 명	심층 강화학습을 사용한 주식투자 전략 개발		
협력기관	(주)SK 텔레콤		
참여학생	이름	전화번호	이메일
	박동진	010-7153-1638	ehdwls1638@pusan.ac.kr
	신재환	010-7999-0048	shinjaehwan622@gmail.com
	정희영	010-4724-5618	h2young5618@pusan.ac.kr
참여교수명	유영환		

## 2. 세부 지도 내용

- 적절한 자금운용 규모를 판단하는 방식으로 '켈리 공식'이라는 것이 있습니다. 이를 활용하면, 전체 자금에서 몇 %의 비중으로 주식을 편입시킬 지 최적의 값을 판단하는 데 도움이 되니 참고하면 좋겠습니다.
- 결과 보고서에는 실제 운용한 주식(5 가지)의 결과를 표시하면 좋겠습니다.
- 실제 인공지능은 어떠한 data 를 가지고 학습하느냐가 매우 중요합니다. 현재 입력 변수들을 조절하면서 성능개선을 하고 있는 것으로 보이는데, 이러한 과정은 의미가 있습니다. 결과 보고서 제출 시점까지 지속적으로 진행해 보면 좋겠습니다.
- 전체 프로젝트에 대한 팀원들간의 이해도가 다른 것 같습니다. 실제 업무 진행은 나눠서 하더라도 프로젝트에 대한 전반적인 이해도는 같은 수준으로 맞추는 것이 좋습니다. 이는 실제로 나중에 회사에서 일을 할 때도 매우 중요합니다.
- 투자에서 가장 중요한 것 중 하나는 risk management 입니다. 매수보다 손절, 익절 시점을 잘 잡아낼 수 있는 것이 중요합니다. 이를 잘 판단할 수 있도록 학습시키면 좋겠습니다.
- 자금 규모 계산시 100%로 얘기했었는데, 1 억원의 자금을 운용한다고 가정하고 키움 Open API 연동을 통해서 모의투자로 거래 체결까지 해보는 것이 좋겠습니다. 설사 AI가 잘 추천을 한다고 해도 이것을 실 투자 수익으로 연결시키기에는 다른 변수들이 많습니다. 그 첫째가 거래 체결여부입니다.

위 내용을 부산대학교 정보컴퓨터공학부 2023 학년도 전기 산학협력프로젝트 지도내용으로 제출합니다.

멘토링 일시	2023 년 9 월 16 일	시작시간	20:30:	종료시간	22:30:
--------	-----------------	------	--------	------	--------

소속: (주)SK 텔레콤

직급: 부장

성명: 김연규

