



# WorldQuant – 퀀트학회 파트너십 제안서

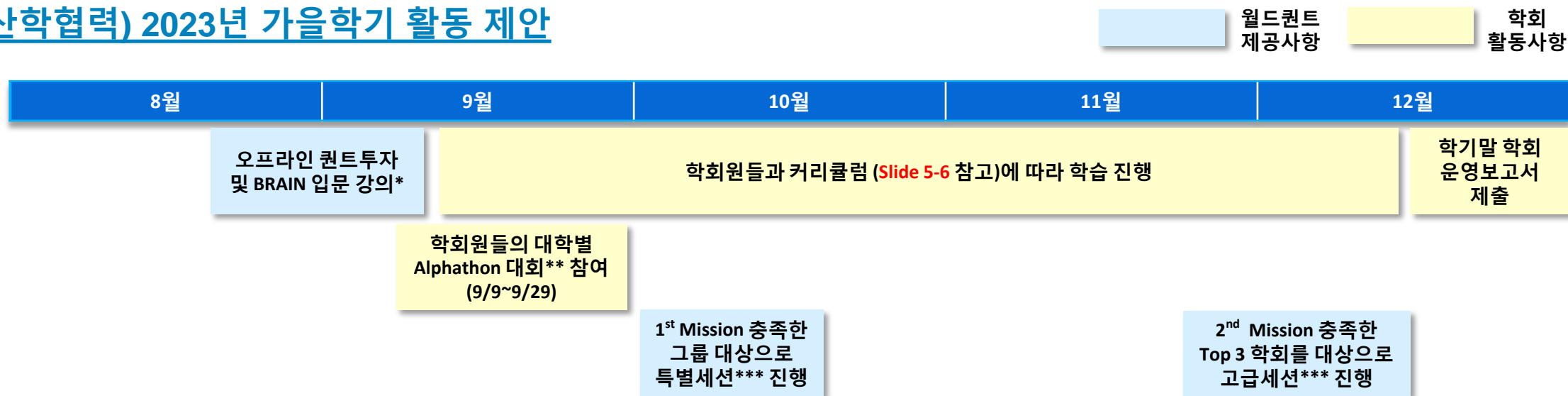
WorldQuant BRAIN Korea  
August 2023

NOT FOR HANDOUT/DISTRIBUTION: FOR PRESENTATION ONLY

Copyright © 2022 WorldQuant, LLC. All Rights Reserved. COMMERCIAL SECRET. THIS DOCUMENT CONTAINS CONFIDENTIAL AND PROPRIETARY INFORMATION OF WORLDQUANT, LLC. UNAUTHORIZED DISCLOSURE OR REPRODUCTION IS STRICTLY PROHIBITED AND MAY RESULT IN SERIOUS LEGAL CONSEQUENCES.

# WorldQuant – 퀀트학회 파트너십 제안 (1)

## 산학협력) 2023년 가을학기 활동 제안



\* 산학협력 활동은 각 학회들을 위해 마련된 월드퀀트의 **오프라인 퀀트투자/BRAIN 입문 강의 및 설명회**로 시작하며, 8월말~9월초 각 학회마다 날짜와 장소가 상이하게 진행 (Slide 4 일정 참고) 될 예정입니다. 캠퍼스에서 진행되는 설명회의 경우 학회 외부에도 홍보가 되어 더 많은 학생들이 참가할 예정이며, 필요시 설명회의 말미에 학회 홍보 시간을 마련할테니 스터디 회원 추가 모집의 기회로 삼으실 수 있습니다.

\*\* 입문강의 이후에 각 학회가 커리큘럼을 진행하면서 직접 실습을 할 수 있는 **대학별 BRAIN 퀀트 모의투자 대회인 Alphathon**에 참가합니다. 대회는 9월 9일부터 29일까지 3주간 진행되며, 각 학교별 우수 참가자에게는 상금 및 월드퀀트 BRAIN 컨설턴트 전환 기회가 주어집니다. 가장 좋은 결과를 낸 이들에게는 월드퀀트 겨울 인턴 채용 기회를 드립니다. (인턴 기회는 산학협력하는 학회들에게만 특별히 드릴 예정입니다.)

\*\*\* Alphathon 대회 기간(3주) 내에 BRAIN 플랫폼에서 Gold Level (개인점수 10,000점 이상)에 도달한 회원 수가 각 학회의 참여인원 대비 50%를 달성할 경우 ("1st Mission"), 월드퀀트에서 **특별 세션**을 10월 중 제공합니다. 이어서 11월 중반까지 각 학회의 BRAIN 컨설턴트 전환율이 가장 높은 상위 3개의 학회원("2nd Mission")들에게만 exclusive하게 **고급 세션**을 월드퀀트에서 추가적으로 제공할 예정입니다. (Slide 7 참고)

# WorldQuant – 퀀트학회 파트너십 제안 (2)

## 산학협력의 기본적인 형태 및 내용

	WorldQuant 제공 사항	학회 제공 사항
Sponsorship / Learning Content / Networking	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ 학기별 기본 활동비 100만원 지급* <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ 학기별 학회 내 컨설턴트 배출 인원에 따라 다음 학기 추가 지원금 (20만원~50만원) 학회별 차등 지급</li> </ul> </li> <li>✓ BRAIN <a href="#">Referral Program</a> (추천 프로그램)을 학회에서 적극 활용시 추천한 컨설턴트 수당 \$200 Fee 지급</li> <li>✓ “Finding Alphas(초과수익을 찾아서)” 서적 및 BRAIN 플랫폼 (<a href="#">Learn 페이지</a>, <a href="#">웹비나</a> 및 <a href="#">한국어 게시판</a>에 게시된 강의영상 및 문서)을 통해 학습 콘텐츠 제공</li> <li>✓ Gold User 및 신규 컨설턴트 전환 기준 충족 시 고급 교육 세션 제공</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ BRAIN 퀀트투자 베이직 커리큘럼 (Slide 4)에 따라 학습 (변형 가능): 한 학기동안 주 1회 (2~3시간) 세션 / 추가 스터디 세션은 자유</li> <li>✓ 해당 커리큘럼 학습 회원들 <a href="#">BRAIN 플랫폼</a> 전원 가입 (9월 8일까지 가입)</li> <li>✓ 학기별 운영보고서 제출: 학기말 1회 제출 (Template 월드퀀트 제공 예정; 회원 목록 및 활동비 사용내역, 다음 학기 그룹리더 연락처 등 포함)</li> <li>✓ 각 학회의 월드퀀트 담당 리서처와 정기적 소통 (학회별 한국어 게시판 및 Zoom 활용)</li> </ul>
Competition / Internship	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ University Alphathon (9/9~29) 대회 우수 참가자 중 상금 수상 및 WorldQuant 겨울 인턴 선발</li> <li>✓ 가장 잘 운영한 동아리의 리더 등 월드퀀트 인턴 추가 선발 가능</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ University Alphathon (9/9~29) 대회에 스터디 구성원 전원 출전 후 최대한 Gold User 달성 및 컨설턴트 전환 노력</li> </ul>
Promotion	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ BRAIN 플랫폼 및 월드퀀트 주최 각종 행사(대회 및 리크루팅 행사 등) 온오프라인 홍보 지원해준 학회들에 특별 굿즈 편당(인당 2-3만원)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ BRAIN 플랫폼 및 월드퀀트 주최 각종 행사(대회 및 리크루팅 행사 등) 온오프라인 홍보 지원 <ul style="list-style-type: none"> <li>*온라인 홍보예시: <a href="https://blog.naver.com/kimjune2020/223116082031">https://blog.naver.com/kimjune2020/223116082031</a> <a href="https://blog.naver.com/slayerzeroa/223074007827">https://blog.naver.com/slayerzeroa/223074007827</a></li> </ul> </li> </ul>

\*단, 활동 인원이 10명 미만일 경우에는 금액이 조정됩니다.

# WorldQuant 파트너십 참여 학회 명단 및 오프라인 입문강의 일정

대상	예상 참여인원*	활동 시작일*	담당자*	오프라인 입문 강의 및 Alphathon 대회 설명회		
				일시 (제안)**	장소	비고
아주대 (FEPSI)	20	TBU	유대명	8월 28일(월) 16:00	월드퀀트 한국지사 사무실	
U.FE.A	20	TBU	허준수	8월 29일(화) 미정	월드퀀트 한국지사 사무실	
FBA Quant	20	TBU	국정오(미정)			
KAIST Seoul (DAR)	8	TBU	허준영	8월 31일(목) 16:00	KAIST 서울 캠퍼스 설명회 (SUPEX경영관)	학회 홍보 가능***
한양대 (HYFE)	10	TBU	이강민	9월 5일(화) 17:30	한양대 캠퍼스 설명회 (HIT)	학회 홍보 가능***
한양대 (HYFIN)	17	TBU	윤선보			
성균관대 (FR)	4	TBU	정상훈	9월 11일(월) 17:30	성균관대 캠퍼스 설명회 (삼성학술정보관 B1 오디오itorium)	학회 홍보 가능***

\* 참여인원 및 활동 시작일은 각 동아리/학회별로 9월초 최종 컨펌할 예정입니다. 담당자 업데이트가 필요한 경우에는 말씀 부탁드립니다.

\*\* 일정은 변동 가능하며, 참여 인원수가 많은 경우 따로 세션을 진행할 수도 있습니다.

\*\*\* 캠퍼스에서 진행하는 세션의 경우, 필요시 세션 말미에 학회 홍보 시간을 따로 구성하여 추가 회원 모집에 도움을 드릴 수 있습니다.

\*\*\*\* 위 일정에 참석하지 못 하는 학회원들은 **9월 8일(금) 17:00**에 예정된 **Zoom 온라인 세션**(내용 동일)에 [신청](#)하여 참여하실 수 있습니다.

# BRAIN 퀀트투자 베이직 스터디 커리큘럼

- ✓ 2023년 3~6월에 월드퀀트에서 제공한 웨비나 시리즈의 주제에 따라 웨비나에서 부족했던 이론적인 설명을 “초과수익을 찾아서(Finding Alphas)” 책 (월드퀀트 저서)의 관련 내용을 요약한 자료를 통해 보충하여 [BRAIN 플랫폼 한국어 기사판](#)에 제공함 (8월 중순 공개 예정)
- ✓ 각 주제에 따라 제공된 교육영상과 이론 요약본을 바탕으로 다음과 같이 **7과로 구성된 커리큘럼** 제안 \*이대로 스터디 세션 진행하는 것을 추천드리나 각 학회의 니즈에 맞게 변경 가능함

#	주제	“Finding Alphas(초과수익을 찾아서)” 책의 관련 챕터	BRAIN 한국어게시판에서 제공하는 교육 콘텐츠
1	[퀀트투자 입문] 알파 리서치, BRAIN 플랫폼, 리서치 컨설턴트 프로그램 소개	1. 알파 설계 소개 2. 알파 연구에 관한 관점 4. 알파 설계 5. 알파를 개발하는 방법: 케이스 스터디 6. 데이터와 알파 설계 31. 웹심(브레인의 전신) 소개	<ul style="list-style-type: none"> <li>➢ 교육영상: <a href="#">퀀트투자 입문</a></li> <li>➢ “초과수익을 찾아서” 책의 관련 챕터 요약본 (링크 추후 업데이트 예정)</li> </ul>
2	주가/거래량 데이터를 이용한 알파	18. 주식 가격과 거래량 7. 매매회전율	<ul style="list-style-type: none"> <li>➢ 교육영상: <a href="#">주가/거래량 데이터를 이용한 알파</a></li> <li>➢ “초과수익을 찾아서” 책의 관련 챕터 요약본 (링크 추후 업데이트 예정)</li> </ul>
3	펀더멘탈(기업 재무정보)를 이용한 알파	19. 재무제표 분석 20. 기본적 분석과 알파 연구	<ul style="list-style-type: none"> <li>➢ 교육영상: <a href="#">펀더멘탈(기업 재무정보)를 이용한 알파</a></li> <li>➢ “초과수익을 찾아서” 책의 관련 챕터 요약본</li> </ul>
4	과적합(Overfitting)을 피하고 알파를 개선하는 방법	12. 알파 강건성 향상을 위한 기법 8. 백테스팅 - 시그널 혹은 과적합?	<ul style="list-style-type: none"> <li>➢ 교육영상: <a href="#">제출 가능한 알파를 개발하는 법, 알파 개선실습</a>, 초과수익을 찾아서</li> <li>➢ “초과수익을 찾아서” 책의 관련 챕터 요약본 (링크 추후 업데이트 예정)</li> </ul>
5	뉴스 데이터를 이용한 알파	22. 뉴스와 소셜 미디어가 주가 수익률에 미치는 영향	<ul style="list-style-type: none"> <li>➢ 교육영상: <a href="#">News 데이터를 이용한 알파</a></li> <li>➢ “초과수익을 찾아서” 책의 관련 챕터 요약본 (링크 추후 업데이트 예정)</li> </ul>
6	옵션 시장 데이터를 통한 주식 수익 정보	23. 주식옵션시장으로부터의 주식 수익률 정보	<ul style="list-style-type: none"> <li>➢ 교육영상: <a href="#">옵션, 벡터, Relationship 데이터필드</a> (4:07 – 12:33)</li> <li>➢ “초과수익을 찾아서” 책의 관련 챕터 요약본 (링크 추후 업데이트 예정)</li> </ul>
7	알파와 리스크 팩터	13. 알파와 리스크 팩터들	<ul style="list-style-type: none"> <li>➢ 교육영상: <a href="#">옵션, 벡터, Relationship 데이터필드</a> (12:34 – 15:23)</li> <li>➢ “초과수익을 찾아서” 책의 관련 챕터 요약본 (링크 추후 업데이트 예정)</li> </ul>

# 추천드리는 스터디 과제 및 Task

- ✓ BRAIN 포럼에 **학회별 비공개 게시판** 생성 예정: 과제는 해당 학회 게시판에 업로드하여 학회원들간 혹은 담당 월드퀀트 리서처와 피드백을 주고 받을 수 있습니다.  
게시판을 통해 서로 활발한 소통이 있길 바랍니다.

## Task List

• "초과수익을 찾아서 (Finding Alphas)" 책 읽고 발제	매주 각 과에 해당되는 책의 챕터(Slide 5 참고)를 읽고 학회원이 세미나에서 발제 책의 아이디어를 브레인에서 활용할 수 있는 방안 (BRAIN 알파 리서치 예시, 책의 내용을 반영한 플랫폼 개선안) 제안
• Operator(연산자) 학습 및 정보 공유	BRAIN 플랫폼 Learn Section에 있는 연산자(Operator) 학습 후 매주 학회 게시판에 1개의 연산자 관련 포스트 업로드 ✓ 알파 예시 (제출 가능한 수준의 알파가 아니라, 연산자의 활용 사례를 볼 수 있는 정도의 알파 예시) ✓ 이론적 근거 - 참고 문헌 (논문, 위키피디아, 초과 수익을 찾아서 등) ✓ 주의사항 (각 알파/시그널/데이터셋의 특성을 연산자/알파표현식이 반영하고 있는가? 데이터의 분포를 고려했는가?)
• 본인의 Best Alpha 선정 후 발표	Alphathon 대회 기간 동안 개발한 알파 중에 Best 알파 전략 몇가지를 선정하여 왜 좋은 알파인지를 발표 (학회원간 경쟁하는 Alphathon 대회 종료 이후인 10월~11월 경 추천) ➢ 학회 내에서 왜 좋은 알파인지 선정하는 과정 및 평가를 위한 기준점 예: <ul style="list-style-type: none"><li>• 알파 아이디어(가설)의 참신성 (참고 문헌이 있으면 가점, 다만 문헌의 전략을 그대로 구현할 필요는 없음. 해당 아이디어를 수정/보완 가능)</li><li>• 알파 아이디어의 브레인 플랫폼 적용 가능성 (새로운 연산자 혹은 참신한 알파표현식을 시도했으면 가점)</li><li>• Unit handling 고려 여부, 과적합(Overfitting)에 대한 고려를 했는지 여부, 강건성 테스트(Robustness Test)를 시도했는지 여부</li><li>• In-Sample 성과</li><li>• 해당 알파 전략의 추가 개선방안 (BRAIN에서는 특정 제약으로 인해 반영하지 못 했으나, 이러한 제약이 없었다면 개선할 수 있는 방안 등)</li><li>• 다른 전략과의 성과 비교 및 해석</li></ul>

# Mission 달성시 제공되는 WorldQuant 추가 세션

가을학기 동안 각 학회별 미션 달성시 월드퀀트에서 다음의 내용으로 추가 고급 세션을 제공해 드립니다.

## 1<sup>st</sup> Mission

9월 9일~29일 대학별 Alphathon 대회기간 내

**Gold Level (10,000점) 달성하는 인원이  
대회 참가인원 대비 50%이상이 될 경우,  
특별강의\* 제공 (10월 중)**

## 2<sup>nd</sup> Mission

11월 중순까지

**학회 전체 인원대비 컨설턴트 전환율이  
가장 높은 TOP 3 학회에게  
고급세션\*\* 제공 (11월말~12월)**

### \*특별강의 주제:

1. 컨설턴트 전환 절차 관련 자세한 안내
2. 컨설턴트 전환 후 사용할 수 있는 다양한 신규 기능(API 활용법 등) 소개
3. 알파 제출 기준을 충족하고 payout을 극대화할 수 있는 팁 및 예시 전달
4. Referral Program 안내

### \*\*고급세션 주제:

1. 팩터이론 및 콤보 테크닉 등 고급 이론 특강
2. 월드퀀트 현직 퀀트리서처 초청 세션
  - 업계 관련 이야기 및 입사 관련 Tip 등 제공
  - 그 밖의 네트워킹 시간

※ 단, 해당 혜택은 BRAIN 커리큘럼 참여 학회원 수가 10명 이상일 경우에만 주어집니다.  
인원이 적을 경우 타 학회 세션에 참가 요청을 하시는 방법도 있으나, 그 경우 타 학회의 동의를 필요합니다.





WORLDQUANT

**BRAIN<sup>®</sup>**

감사합니다.