



데이터로 하는 주식 투자, 올라떼

2021년 12월 ver.

01 Problem

데이터로 하는 투자 왜 힘들까?

데이터로 하는 투자 왜 힘들까?

Problem 1. 신뢰할 수 없는 데이터

- Garbage In Garbage Out
- 현재 확인되는 데이터를 크롤링하면 생기는 문제 직면
- 미래 참조, 상장 폐지, 수정 공시 등을 고려하지 않은 백테스팅 오류

Problem 2. 제한된 국가, 제한된 기회

- 데이터 관리가 어려워지면서 특정 국가에 대한 데이터에만 의존
- 전략 검증을 특정 국가에 대해서만 확인할 경우 발생하는 과최적화 이슈
- 유의미한 전략을 발견하더라도 한 국가에만 투자해 성공확률이 낮아짐

Problem 3. 특정 전략에 의존

- 다양한 팩터를 구축하기 위해서는 개발 뿐만 아니라 도메인 지식도 필요
- 투자 아이디어를 즉각적으로 검증하기 어려워지면서 특정 전략에 의존
- 팩터의 사이클에 따라 수익률 편차가 커져 투자를 지속하기 어려움



올라때가 없앤 장벽

1. 신뢰할 수 있는 데이터 축적

- LSEG(런던증권소 그룹)에서 제공받는 양질의 데이터
- 상장 폐지는 물론 정보를 확인할 수 있는 시점(Point In Time) 데이터를 개별 관리
- 지금 확인되는 가장 최신의 데이터를 언제나 접근

2. 투자 가능한 주요 주식시장에 모두 접근

- 접근성이 높은 5개국 선공개 (한국, 미국, 중국, 홍콩, 일본)
- 2005년 이후 부터의 데이터를 모두 활용하여 전략 조합 설정

3. 다양한 팩터들을 한 번에 백테스팅 까지

- 가격, 재무 데이터 뿐만 아니라 내부자 거래, 애널리스트 전망을 모두 데이터화하여 집계
- 클릭 몇 번으로 원하는 팩터로 종목을 찾고, 백테스팅 까지 한 번에



간단한 조작으로
종목과
백테스팅 확인

STEP 01

기본 설정

투자국가

미국

중국

홍콩

일본

한국

미국

STEP 02

가치 ① 7

PBR (현재 가격 / 장부가치) ①

PER (현재 가격 / 순이익) ①

PSR (현재 가격 / 매출액) ①

P/CF (현재 가격 / 순현금이익) ①

추정이익 반영 PER ①

RPR (R&D 투자 / 시가총액) ①

현재 시가총액 ①

효율성 ① 9

수익성 ① 17

성장성 ① 25

건전성 ① 12

가격 ① 12

STEP 03

종목찾기 →

백테스팅 →

성과 요약

| | 전략 | 벤치마크 |
|-------------|---------|---------|
| 누적 수익률 | 450.61% | 329.33% |
| 연율화 수익률 | 10.13% | 8.59% |
| 연율화 변동성 | 22.31% | 16.92% |
| 샤프지수 | 0.45 | 0.51 |
| 최대 손실 (MDD) | -36.79% | -41.12% |



주식 데이터가 쉬워지는 기능들

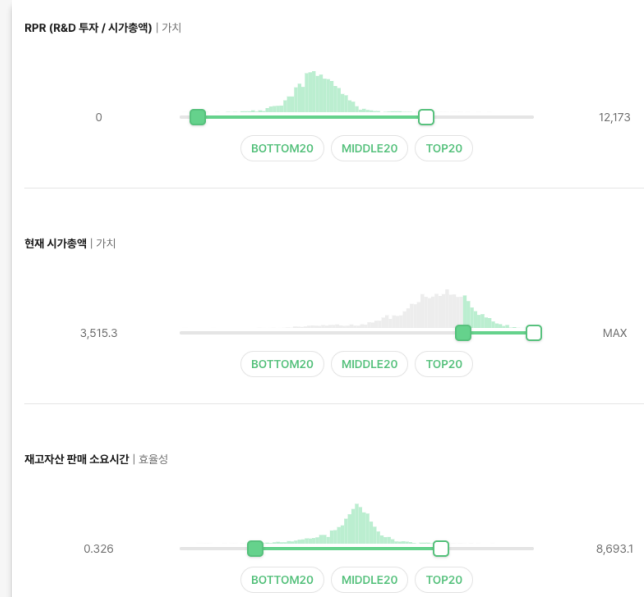


1 대표적인 주식 전략 확인

투자 전략 스코어 ① 10

- 워렌 버핏 가치 스코어 ①
- 피터 린치 성장 스코어 ①
- 켄 피셔 성장 스코어 ①
- 드레먼 역발상 스코어 ①
- 피오트로스키 턴어라운드 스코어 ①
- 가격 모멘텀 스코어 ①
- 성장 모멘텀 스코어 ①
- 이익 모멘텀 스코어 ①
- 모멘텀 가치 스코어 ①
- 성장 가치 스코어 ①

2 재무 데이터의 회사 분포를 한 눈에



3 로딩 화면을 보기 힘든 백테스트 속도





Thank you