

폭삭 벌었수다 | 실전 퀀트알고리즘

nerdcon2024 @주홍철

주홍철 소개 : 책, 강의하는 어비스 대표 개발자

2022년 5월 10일 IT 모바일 일별 베스트
전일 온라인과 매장에서의 판매 데이터를 기준으로 집계되었습니다.

2022년 5월 10일 조회

1 2 3 4 5 6 7 8 9 10

판매량 신상품 최저가 최고가 상품명

20개씩보기 품절포함 자세히

1.  [도서] 면접을 위한 CS 전공지식 노트 : 디자인 패턴, 운영체제, 데이터베이스, 자료 구조, 네트워크, 개발자 면접(코딩 면접 단어장 증정(포인트 차감, 한정수량))

주홍철 저 | 길벗 | 2022년 04월

24,000원 → **21,600원** (10% 할인) | YES포인트 1,200원 (5% 지급)

회원리뷰 (8개) | 내용 ★★★★★ | 편집구성 ★★★★★

지금 주문하면 내일 아침 7시 전(5/11, 수) 도착예정

수량 1

선착순 사은품 내일은 개발자! 코딩테스트 대비 도서전 (22.05.04 ~ 22.12.31)

사은품 (코딩 면접 단어장 증정) 『면접을 위한 CS 전공지식 노트』 (22.04.28 ~ 한정 수량)

사은품 기획전 월간 개발자 2022년 5월호 (22.04.29 ~ 22.05.31)

사은품 소중한 당신에게 5월의 선물 - 윤동주 3단 우산/용돈봉투/굿리더 골프 토트백/윤동주 텀머그 (22.04.29 ~ 22.05.13)

디자인 패턴, 네트워크, 운영체제, 데이터베이스, 자료 구조, 개발자 면접과 포트폴리오까지! CS 전공지식 습득과 면접 대비, 이 책 한 권이면 충분하다! 개발자 면접에서 큰 비중을 차지하는 CS(Computer Science) 전공지식! 디자인 패턴부터 자료 구조까지 알아야 할 게 너무 많은데, 어떻게 준비해야 할까? 이 책은 ...

카트에 넣기
리스트에 넣기
바로 구매하기



10주완성 C++ 코딩테스트 | 알고리즘 코딩테스트

큰돌

▶ 학습중

158 / 247 강 (64.49%)

독점



CS 지식의 정석 | 디자인패턴 네트워크 운영체제 데이터베이스 자료구조

큰돌

▶ 학습중

143 / 213 강 (67.14%)

Update

독점

<https://aviss.kr/review/view.php?seq=9>

<https://aviss.kr/review/view.php?seq=5>

퀀트란?

퀀트 = '가설 기반 시스템화된 투자'

퀀트 := {알파, 베타} 전략을 중심으로 하는 투자

알파: 전략적 우위, 정보비대칭을 이용한 투자

베타: 시장 트렌드 추종

+ 고려해야할 부분

- 시장 상황(마켓 레짐)에 따른 전략 필요

- 자동매매시 숨겨진 비용(수수료, 슬리피지)

전략구축시 고려해야할 부분 #1. 데이터

(POC, 백테스팅, 배포 및 검증)

- 데이터의 생존편향이 없어야 함.

ex) 군사 장비 분석 (제2차 세계대전)

돌아온 전투기의 탄착 흔적만 보며 장갑을 보강할 부위를 결정하려 했다가, 귀환하지 못한 항공기에는 다른 부위가 더 맞았을 수 있음

반드시 전체 모수를 고려한 정제 필요

전략구축시 고려해야할 부분 #2. 마켓레짐

- 뉴스/공시/보고서 등 비정형 텍스트 : 단어 분포 → 문서 → 클러스터 → 토픽 도출

[BERTopic, LLM]

ex)

악재 토픽 확산 → 종목 회피

호재 클러스터 형성 → 업종 단위 매수

- 트렌드 분석 (트럼프 트윗)

트럼프, 관세 유예 직전 “지금 사라 DJT” SNS...특정 종목 언급 ‘시장 조작’ 비판



Donald J. Trump ✓

@realDonaldTrump

THIS IS A GREAT TIME TO BUY!!! DJT

5.84k ReTruths 29.7k Likes

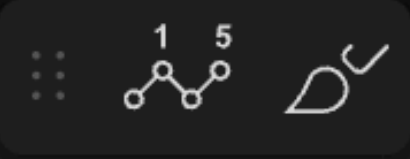
Apr 09, 2025, 10:37 PM

도널드 트럼프 미국 대통령이 관세 유예 발표 4시간 전 자신의 소셜미디어 트루스소셜에 “지금 매수하기 좋은 시점입니다!!! DJT!”라고 올렸다. 트루스소셜 캡처





BTCUSD (+) | 1m 3m 5m 15m 30m 1h 2h 4h D | | Indicators | | Alert | Replay |



전략구축시 고려해야할 부분#3. 모델

데이터레이크

클러스터링

모델링

검증

배포

전략구축시 고려해야할 부분#3. 모델

데이터 클러스터 검증 **모델링** 배포

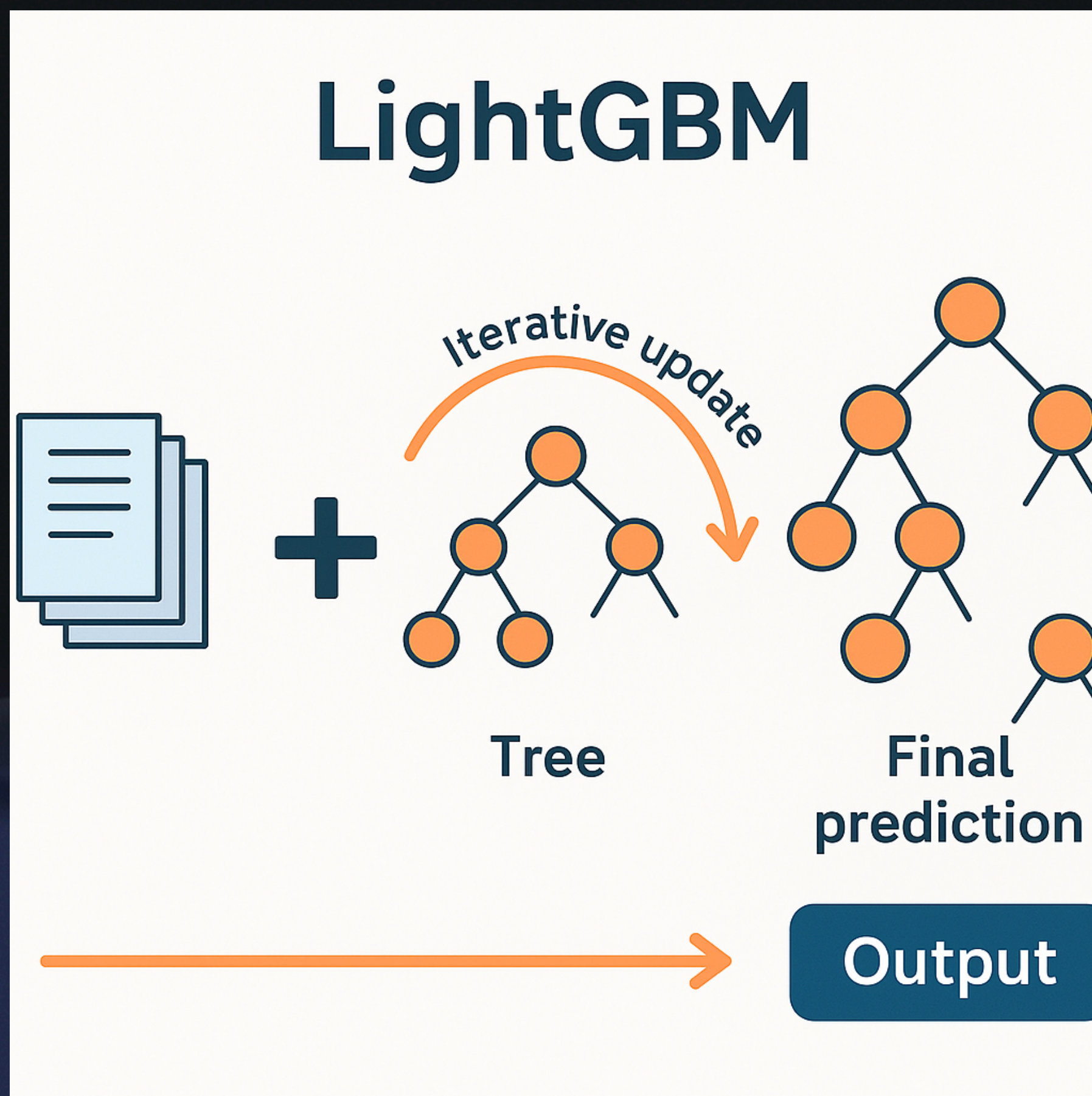


Tesla : 롱 숏 모두 맞춤



Light Gradient Boosting Machine

Python-package passing R-package passing CUDA Version passing Static Analysis passing Azure Pipelines failed
 build passing docs passing Link checks failing license MIT python 3.7 | 3.8 | 3.9 | 3.10 | 3.11 | 3.12 | 3.13 pypi v4.6.0
 conda v4.6.0 CRAN 4.6.0 nuget v4.6.0



결정 트리를 여러 개 순차적으로 학습 -> 예측

1. 초기 예측값 0
2. 실제값과 예측값의 차이 (잔차) 계산
3. 잔차를 예측하는 결정 트리를 하나 만듦
4. 예측값 = 기존 예측 + 학습률 × 새 트리의 출력값
5. 이 과정을 여러 번 반복해서 최종 예측값을 계산

즉, 각각의 결정 트리는 이전 예측의 실수를 보완

```

[Node 0] if sma_5 > sma_20:
  └─ Yes → [Node 1] if volume > 500000:
    └─ Yes → 예측값: 상승 확률 = 0.8
    └─ No  → 예측값: 상승 확률 = 0.6
  └─ No  → [Node 2] if close < 27000:
    └─ Yes → 예측값: 하락 확률 = 0.9
    └─ No  → 예측값: 하락 확률 = 0.6
  
```


Live Coding