

(별첨)

# 퀀트 모델링 실습 특설과정 모집안내

2014. 9

## 1 배 경

- 글로벌 저성장·저금리 기조가 지속되는 가운데 고객 수익 극대화를 위해 자산운용, 포트폴리오 관리 전문성 제고 시급
  - 투자 리스크는 최소화하되 리스크 대비 수익을 극대화할 수 있는 퀀트양성을 위해 ‘퀀트 모델링 실습 특설과정’ 개설

### < ‘퀀트 모델링 실습 특설과정’ 요약 >

과정구분	교육기간	교육시간	교육일시	교육대상
특설과정	‘14.10.7(화)~11.11(화)	40시간 (10일)	17:00~21:30	회원사 및 연기금 임직원

※ 모집기간 : 9.3(수) ~ 10.1(수)

## 2 과정특징

- 교육생 스스로가 퀀트 운용모델을 설계할 수 있도록 유도
  - 엑셀을 활용하여 실시간 데이터의 해석과 가공, 퀀트 운용 모델 설계, 해당 모델 시뮬레이션을 통한 검증 등을 실습
- 한국 증시에서 활용 또는 변형 가능한 퀀트 운용모델 학습
  - 한국 주식투자 사례를 중심으로 증시패턴, 투자자 심리, 증시수급을 반영할 수 있는 퀀트 운용모델\* 개발 교육
    - \* 투자이론, 계량분석, 기술적 분석 등을 종합적으로 활용하는 종목 스크리닝 모델, 팩터 모델, 섹터 로테이션 모델, 마켓 타이밍 모델, 롱숏 페어트레이딩 모델 등
- 업계 최초로 강사의 실습 지도형 교육 추진
  - 모델설계 지도강사와 교육생간 1:1피드백 형식으로 진행

### 3 과정구성

◆ 참여 교육생 맞춤형 퀀트 운용모델 개발이 가능하도록 해당 모델링 설계 실습과 실무사례 중심의 교육과정 구성

No	과목	주요 내용	시간
1	퀀트 투자 현황	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 퀀트와 퀀트 트레이딩의 이해</li> <li>- 퀀트 트레이딩 비즈니스의 구조</li> <li>- 국내외 퀀트 펀드 트렌드 변화</li> </ul>	4
2	퀀트 투자모델 구조와 운용	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 알파모델</li> <li>- 리스크모델</li> <li>- 거래비용모델</li> <li>- 포트폴리오 구성 모델</li> <li>- 모델을 통한 포지션 조절, 진입·청산, 리밸런싱</li> </ul>	4
3	금융 데이터 처리·가공 실습	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 데이터 선별과 가공방법</li> <li>- 데이터 노이즈 처리 실습</li> <li>- 데이터 프로그램 활용 노하우 습득 및 실습</li> <li>* 퀀티와이즈, 블룸버그, 데이터스트림 등</li> </ul>	4
4	투자 아이디어 개발과 백테스팅	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 투자 아이디어 개발 사례와 개발 실습</li> <li>- 백테스팅 방법 실습 및 유의사항 검토</li> <li>- 데이터 bias 처리 방법 학습 및 실습</li> </ul>	4
5	기본적·기술적 분석을 활용한 주가 패턴 모델 설계	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 이익 모멘텀 포착</li> <li>- 밸류에이션 검증</li> <li>- 수익성 펀더멘탈 분석</li> <li>- 데이터 처리 실습</li> <li>- 오실레이터 분석 및 활용 실습</li> <li>* 주가 추세, 모멘텀, 캔들, MACD, 스토크스틱 등</li> <li>- 주가 패턴을 모델링하는 방법 학습 및 실습</li> </ul>	4

No	과목	주요 내용	시간
6	계량 분석을 통한 증시 모니터링 모델 설계	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 펀더멘탈 팩터 분석을 통한 증시 모니터링</li> <li>- 국가별 증시간 상관관계</li> <li>- 글로벌 펀드 플로우</li> <li>- 국내외 업종 수익률 패턴</li> <li>- 매크로 변수 가공 및 모델 설계</li> </ul>	4
7	팩터 모델, 업종 모델, 페어트레이딩 모델 설계	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 주식 펀더멘탈 분석</li> <li>- 멀티 팩터 포트폴리오 개발 실습</li> <li>- 업종 투자매력도 분석 모델 개발 실습</li> <li>- 업종 로테이션 모델 개발 실습</li> <li>- 페어트레이딩 모델 개발 실습</li> </ul>	4
8	주식 롱숏 모델 개발	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 페어 롱숏</li> <li>- 펀더멘탈 롱숏</li> <li>- 테크니컬 롱숏</li> <li>- 롱숏 모델 설계 실습</li> <li>- 주식 숏 트레이딩 모델 개발 실습</li> </ul>	4
9	마켓 타이밍 모델 및 해외자산 트레이딩 모델 설계	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 주가지수 모멘텀 분석 모델</li> <li>- 마켓 타이밍 모델 개발 방법</li> <li>- Global Macro 트레이딩 모델 설계 실습</li> </ul>	4
10	퀀트 투자의 미래 및 경쟁력 유지 방법	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 퀀트 전략 및 성과 평가</li> <li>- 모델 성과 개선 방법</li> <li>* 모델 리스크, 국면 전환 리스크, Tail 이벤트 관리</li> <li>- 퀀트 최신 이론 소개</li> <li>- 퀀트 경쟁력 유지 방법</li> </ul>	4
<b>총 시간</b>			<b>40</b>

※ 상기일정은 소폭 변동될 수 있습니다.

## 4 모집 요강

- (모집기간) '14.9.3(수)~10.1(수)
- (교육일정) '14.10.7(화)~11.11(화)(10일(매주 화·목), 40시간(매회 4시간))
- (교육장소) 교육원 901호 강의실(9층)
- (교육대상) 회원사, 연기금, 공제회, 은행, 보험, 투자자문사
  - 프랍데스크, 리서치, 상품개발, 구조화 금융 부서 종사자
  - 고객 자산관리 수익성을 높이고자 하는 지점영업 임직원
  - 퀀트 투자모델 개발 실무를 익히고자 하는 일반인
- (교육정원) 60명

※ 본 교육과정은 조기 마감될 예정이므로 정원 초과시 교육원이 정하는 기준에 따라 교육생을 선정 또는 제한할 수 있음

- (이수기준) 출석률\* 80% 이상

\* 출석률(%) = (출석시간÷총수업시간) × 100

- (수강료)

회원구분	정회원	준·특별회원	기타
수강료	500,000원	800,000원	1,000,000원

※ 문의 : 교육원 서일영 (Tel 2003-9833, Email suhchodong@kofia.or.kr)