

QUANTEC

관텍 주식회사 소개 자료

1. 회사소개

주요 사업

머니포트

B2C
자산관리 마켓 서비스

오프라인과 온라인을 결합하는
新 개념 글로벌 자산관리 마켓
“자산관리의 시작과 끝 머니포트”

큐오스크

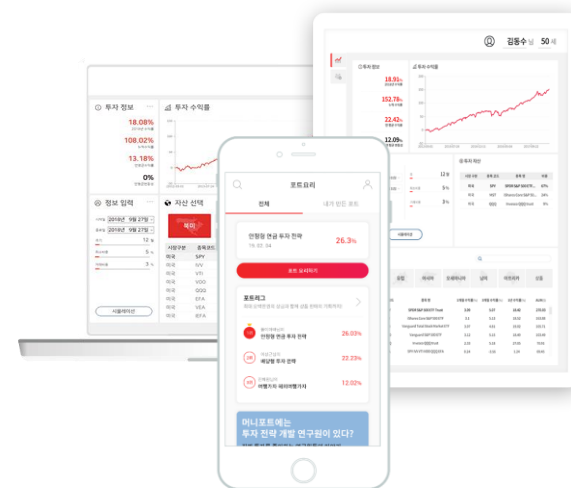
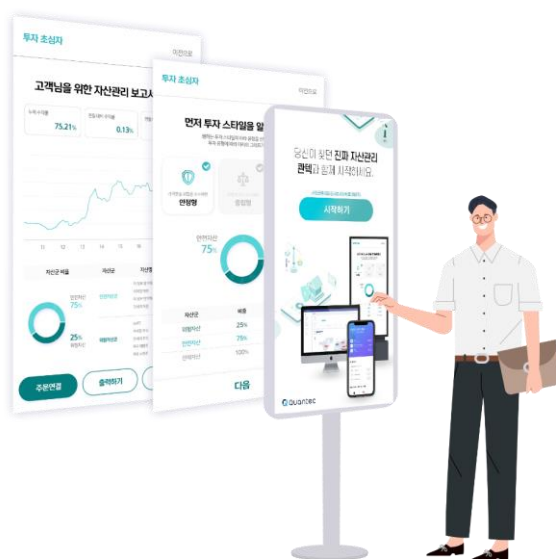
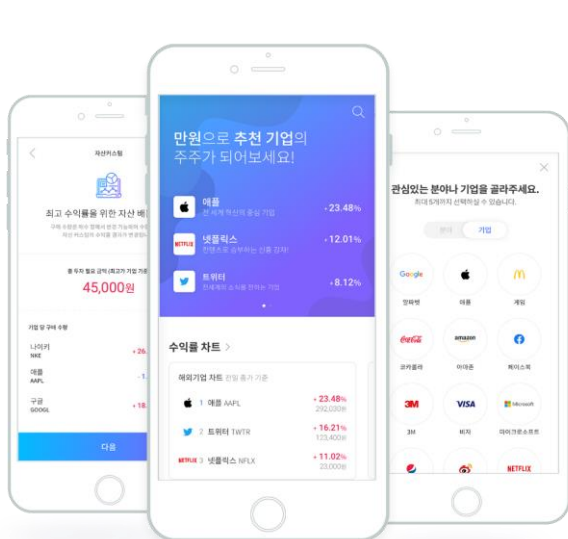
Q-osk
무인화 점포 솔루션

대학가, 지하철 역사 등 설치 하여 계좌개설,
자산배분 포트폴리오 구성 및 직원 연결 가능!
“최초 자산관리 무인화 점포 솔루션”

아이라

Interactive Robo Advisor
로보 어드바이저 개발 솔루션

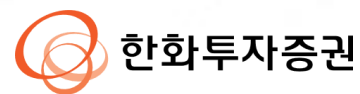
관택의 모든 기술을 집약한, 사용자 눈높이
에 맞춰진 로보 어드바이저 개발 솔루션
“누구나 만드는 로보 어드바이저”



1. 회사소개

주요 협력사

관텍은 **머니포트** 개발, **아이라** 공급까지
수준 높은 대형 금융사를 선도하며, 함께 하고 있습니다.



1. 회사소개

연혁

2019

투자자문사 등록

IBK기업은행, 신한캐피탈 등 Series-A 30억 투자 유치

금융위원회 로보어드바이저 테스트 베드 참여

신한금융투자, NH투자증권과 국내 최대 20여개 알고리즘

2017

신한금융투자 MOU

관텍 & 신한금융투자 투자전략 운용 시작

9개 알고리즘 투자전략 운용

알고리즘 환경 구축 완료

DB, Stock Picking 엔진, Asset Allocation 엔진

2020 (진행중)

2월 머니포트 서비스 런칭

아이라(신한, NH, KB) 도입 준비

랩어카운트·신탁(신한, 교보, 메리츠, 하나 등) 런칭 준비

공모펀드(IBK, NH-Amundi) 런칭 준비

2018

한화투자증권 MOU

이데일리 MOU

AG 인베스트먼트 Pre-A 6억 투자 유치

신한금융투자 계약 완료

알고리즘 트레이딩 콘텐츠 제휴

신한금융그룹 퓨처스랩, 한화생명 드림플러스 선정

2016

창업

2. 트렌드를 알아야 금융의 미래가 보인다

시장의 크기



자산관리 시장
1,001조

ELS, DLS 95

공모펀드 400

특정금전신탁 391

랩어카운트 115

2. 트렌드를 알아야 금융의 미래가 보인다

제도의 변화, 새로운 기회

v1.0
간편 송금, 간편 결제



“물건 사고 송금 하는데
이렇게 복잡한 인증 절차를 거쳐야 할까?”

2014년
공인인증서 의무 사용 폐지



v2.0
인터넷 은행



“온라인 시대에 아직도 은행이나 증권사에
직접 방문해 계좌를 개설해야 할까?”

2016년
온라인 계좌 개설 허용



v3.0
자산 관리



“오프라인에서만 계약할 수 있는 맞춤형
자산관리 서비스 온라인에서는 할 수 없을까?”

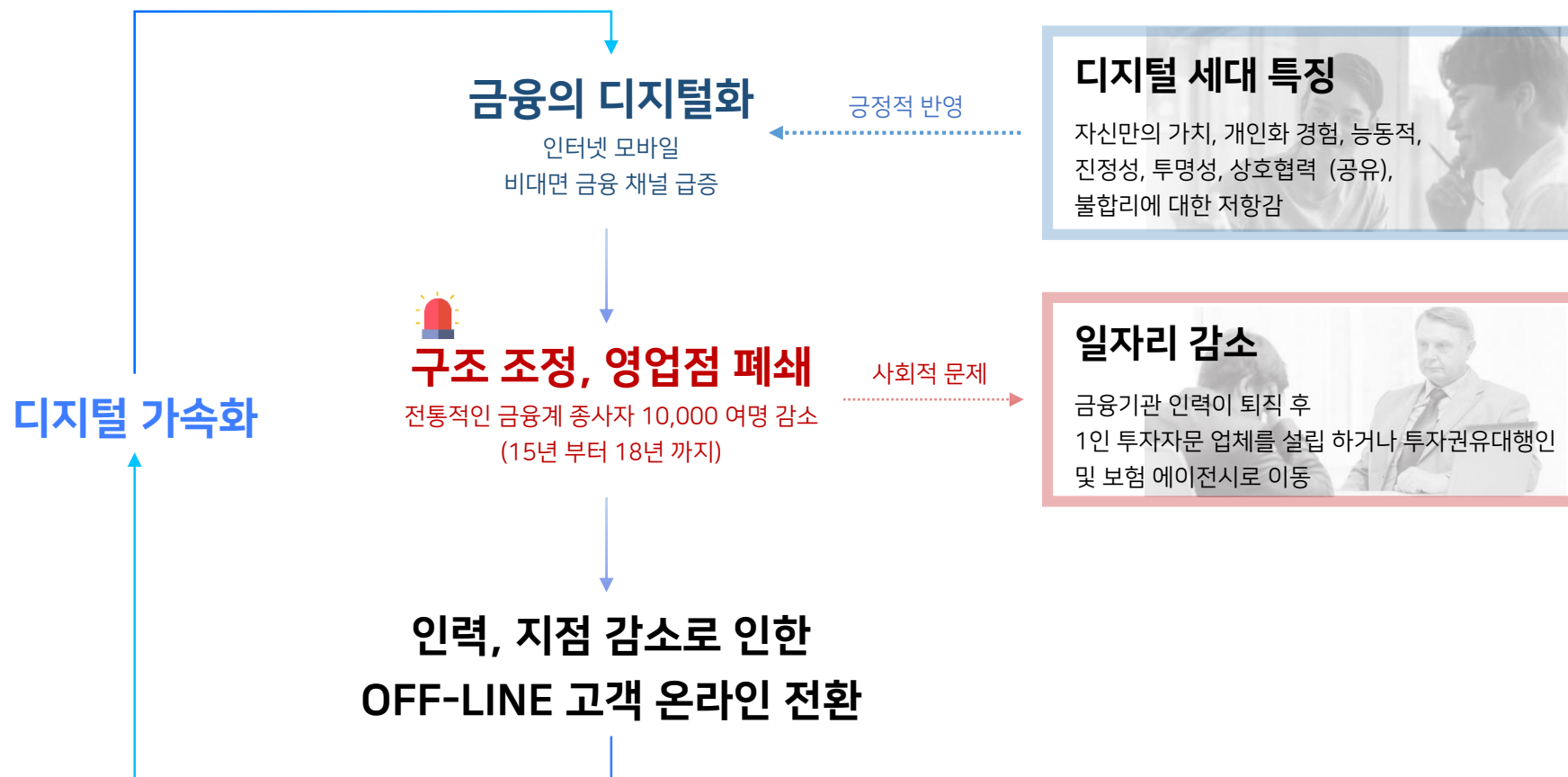
2018년
온라인 일임 계약 허용



온라인 일임계약이란? 은행, 증권사 창구에서 직원을 통해 가입해야 했던 상품을 온라인 계좌개설과 같이 비대면, 온라인으로 가능해 지는 것
일임계약과 온라인 펀드 차이점? 펀드는 가입한 고객의 돈을 하나로 묶어 운용하는 집합투자로 개인화 제공 및 관리가 불가능 하지만 일임계약은 고객 개별 계좌를 관리 하므로 개인화 제공 및 관리 가능

2. 트렌드를 알아야 금융의 미래가 보인다

시장의 변화, 금융의 디지털화



2. 트렌드를 알아야 금융의 미래가 보인다

운용의 변화, 사람의 주관이 철저히 배제 된다

"펀드 매니저 못믿어" 인덱스로 돈 몰린다

HOME > 국제경제
헤지펀드의 굴욕?... "원숭이 주식투자 수익률 절반도 안 돼"

월가 험슨 팩터투자, 한국서도 빠르게 확산 중-펀드매니저 직관 대신 빅데이터 믿는다

장기투자 권하며 펀드매니저 수시로 바꿔 불신 자초

[중앙일보] 입력 2017.07.07 01:00 · 경제 5면 | 지면보기

펀드매니저 중심 액티브 펀드

2000년 초 '펀드 광풍'
2007년 131조 8866억 돌파
미래에셋 '박현주 1호 펀드'
현대증권 '바이코리아 펀드'

과도기 ETF

'02년 최초 출범
15년 만에 89배 성장 40조 규모
KODEX 200, KOSDAQ 등 인덱스를
추종하는 단순한 원리로 만들어짐

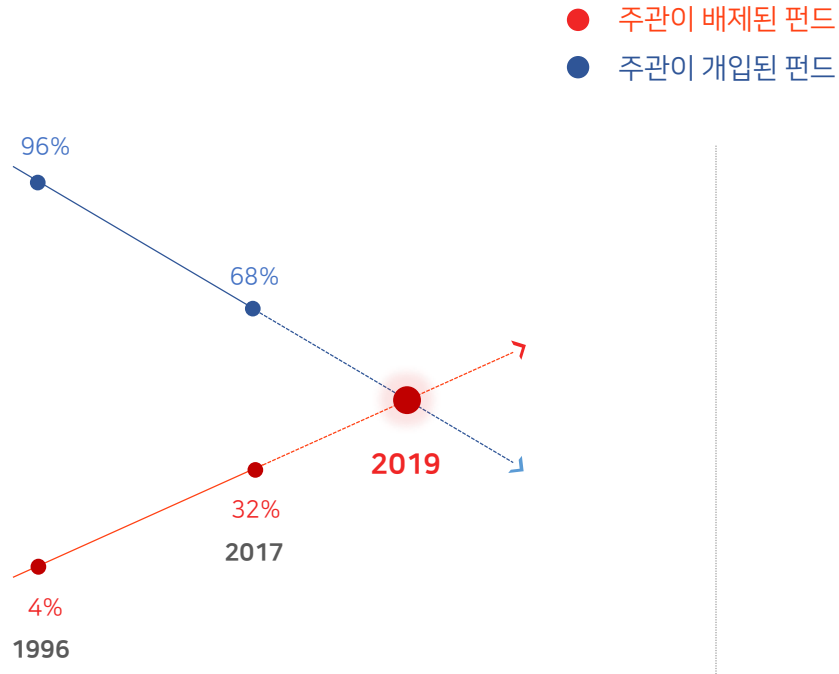
철저한 규칙 중심

Smart beta ETF

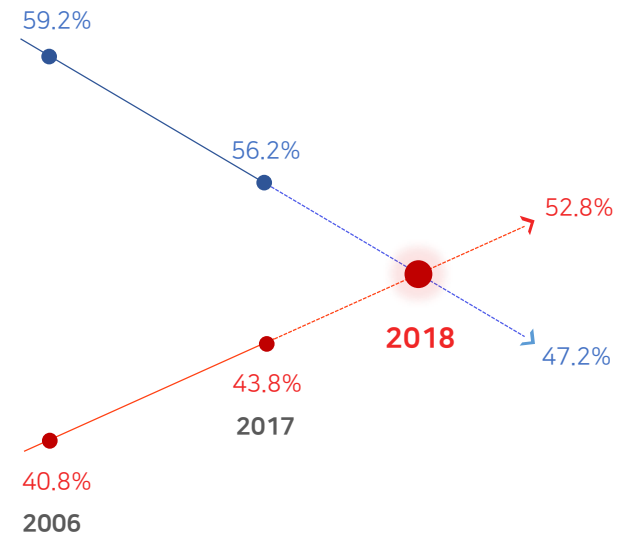
미국 전체 ETF 자금 중 25% 유입
폭발적 성장세
액티브 펀드의 장점과 ETF의 장점을 합쳐
액티브 펀드의 대체재로 부상

2. 트렌드를 알아야 금융의 미래가 보인다

거세게 불어 닥치는 운용 방식의 변화



미국 펀드 점유율 2019년 12월 역전



한국은 이미 2018년 초 역전

2. 트렌드를 알아야 금융의 미래가 보인다

하지만 현재, 온 · 오프라인 시장

모든 온라인 자산관리 업체가 15% 시장에서 각축전
하지만 85% 는 자산관리사가 대면을 통해 오프라인에서 판매 되고 있다.



15%

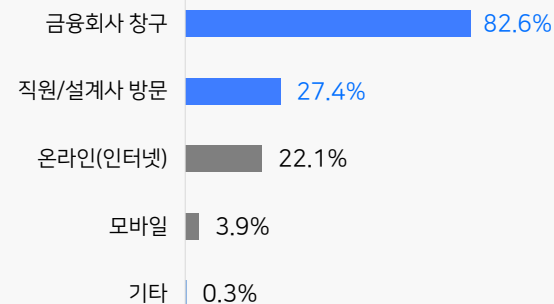
온라인 판매 비율



85%

오프라인 판매 비율

금융투자상품 구매 채널



3. 금융의 미래 “머니포트” & “IRA”

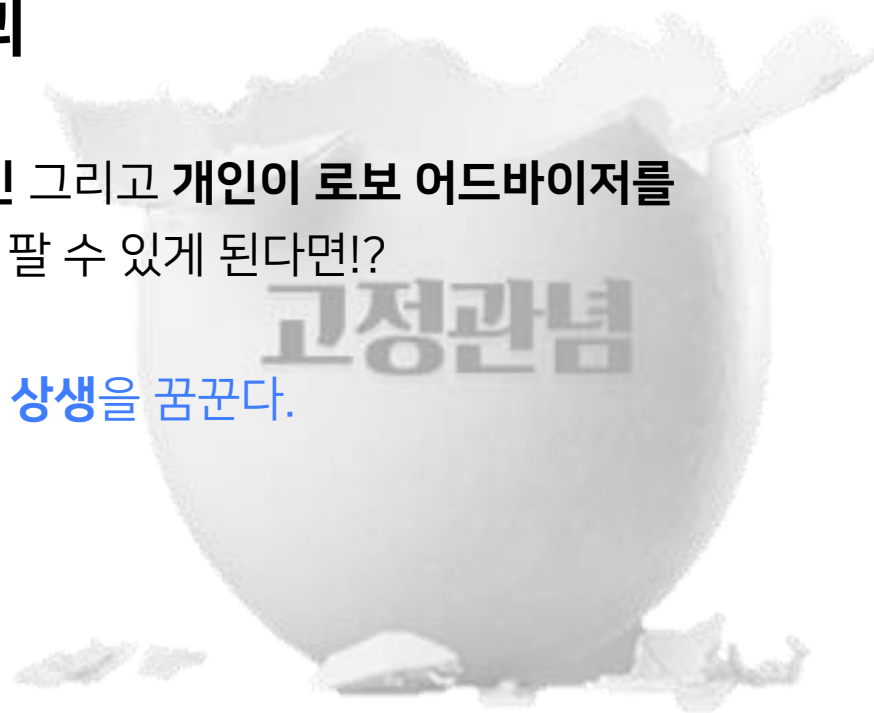
온 · 오프라인 아우르는 상식의 파괴

모든 증권사, 은행, RA업체 의 상용 가능 로보 어드바이저 알고리즘 고작 35개
이런 알고리즘, 전문 업체만 만들 수 있는 걸까?

상식의 파괴

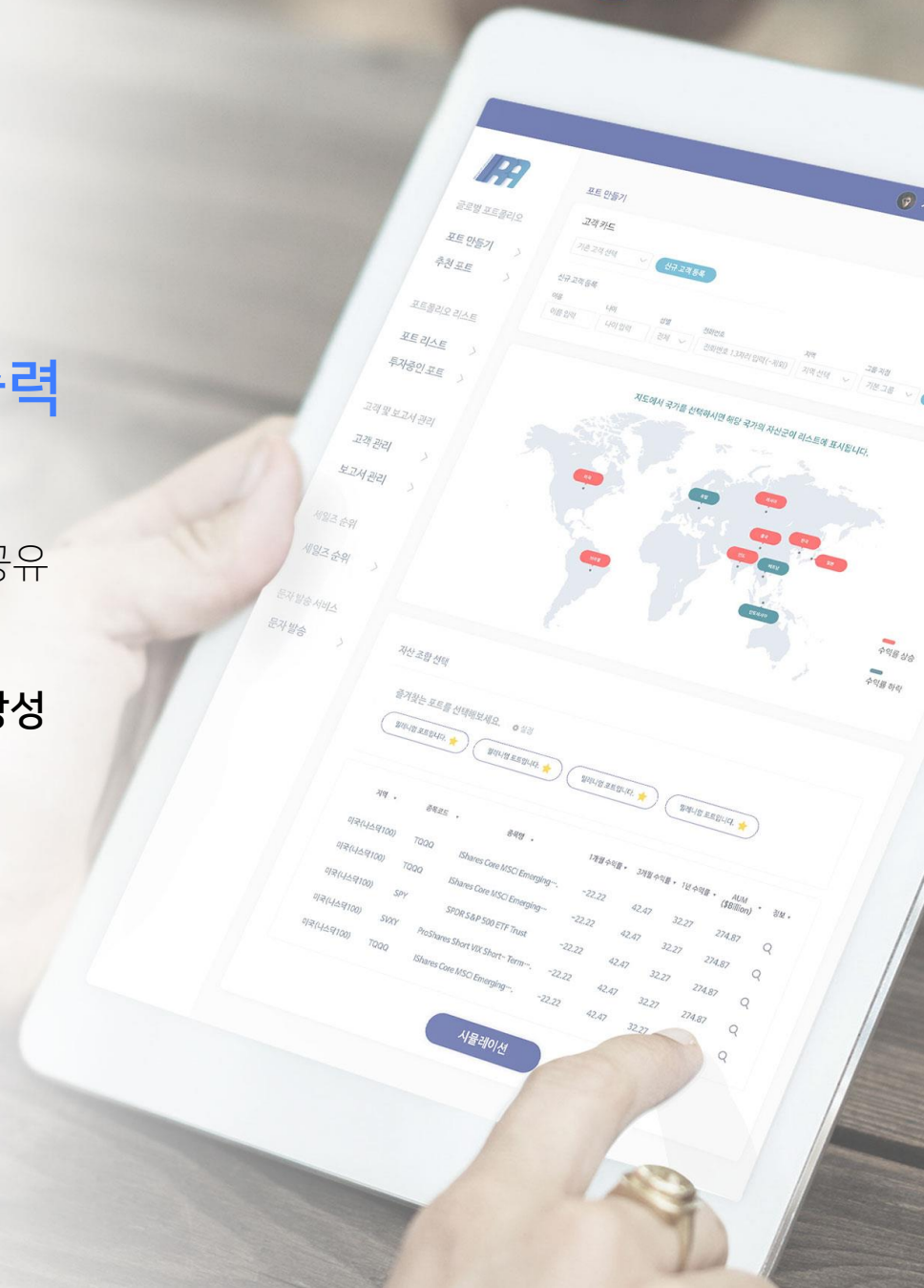
금융상품판매 최전선에 있는 수 많은 판매 대행인 그리고 개인이 로보 어드바이저를
만들어서 온 · 오프라인 고객에게 팔 수 있게 된다면!?

디지털에서 소외되는 그들과 상생을 꿈꾼다.



상식의 파괴가 가능한 차별적인 기술력

- ✓ 누구나 쉽고 간편한 **맞춤 포트폴리오 설계**
- ✓ 내가 만든 포트폴리오, **머니포트**에 올려 판매하고 공유
- ✓ 알고리즘에 기반한 **자동화된 포트폴리오 관리**
- ✓ 암호화폐, P2P펀드 등 **다양한 상품**까지 가능한 **확장성**



3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

상식의 파괴가 가능한 차별적인 기술력

자산관리 전문가 김아영님

글로벌 포트폴리오

포트 만들기 >

추천 포트 >

포트폴리오 리스트

포트 리스트 >

투자종인 포트 >

고객 및 보고서 관리

고객 관리 >

보고서 관리 >

세일즈 순위

세일즈 순위 >

문자 발송 서비스

문자 발송 >

포트 만들기

지도에서 국가를 선택하시면 해당 국가의 자산군이 리스트에 표시됩니다.

자산 조합 선택

즐거찾는 포트를 선택해보세요. ☐ 설정

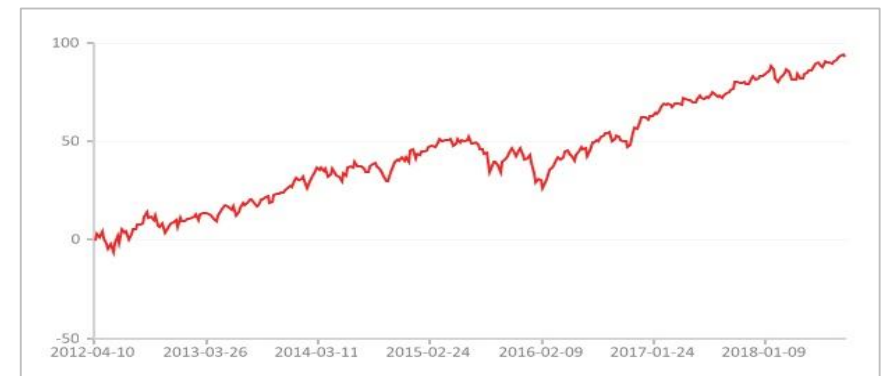
일레니엄 포트입니다. ★ 일레니엄 포트입니다. ★ 일레니엄 포트입니다. ★ 일레니엄 포트입니다. ★

지역	종목코드	종목명	1개월 수익률	3개월 수익률	1년 수익률	AUM (\$Billion)	정보
관택1호	Q001	미국&글로벌펀테크 포트폴리오	2.45	5.42	15.41	0	Q
미국(나스닥100)	QQQ	Invesco QQQ Trust	-1.00	5.01	5.62	164.86	Q
미국(S&P500)	SPY	SPDR S&P 500 ETF Trust	0.30	4.24	5.75	274.87	Q
대한민국(코스피)	KS105560	KB금융	-2.68	5.34	-16.64	0	Q
대한민국(코스피)	KS005930	삼성전자	-3.12	-3.12	-14.97	0	Q

시뮬레이션

금융공학을 바탕으로 실시간(5초 이내)으로
모든 투자상품의 **최적 투자비중 도출** 구현

지역	종목코드	종목명	1개월 수익률	3개월 수익률	1년 수익률	AUM (\$Billion)	정보
관택1호	Q001	미국&글로벌펀테크 포트폴리오	2.45	5.42	15.41	0	Q
미국(나스닥100)	QQQ	Invesco QQQ Trust	-1.00	5.01	5.62	164.86	Q
미국(S&P500)	SPY	SPDR S&P 500 ETF Trust	0.30	4.24	5.75	274.87	Q
대한민국(코스피)	KS105560	KB금융	-2.68	5.34	-16.64	0	Q
대한민국(코스피)	KS005930	삼성전자	-3.12	-3.12	-14.97	0	Q



Backtest Algorithms 기술로 최적 투자비중을 이용해
과거부터 투자한 **성과 시뮬레이션** 구현

소비자의 눈높이에 맞춰 기술 집약한 관택의 차별적 기술력

3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

전문가가 만드는 생태계

- 글로벌 포트폴리오
- 포트 만들기 >
- 추천 포트 >
- 포트폴리오 리스트
- 포트 리스트 >
- 투자종인 포트 >
- 고객 및 보고서 관리
- 고객 관리 >
- 보고서 관리 >
- 세일즈 순위
- 세일즈 순위 >
- 문자 발송 서비스
- 문자 발송 >

자산관리 전문가 김아영님

포트 만들기

① 지도에서 국가를 선택하시면 해당 국가의 자산군이 리스트에 표시됩니다.

수익률 상승
수익률 하락

자산 조합 선택

즐거찾는 포트를 선택해보세요. < 설정

일레니엄 포트입니다. ★ 일레니엄 포트입니다. ★ 일레니엄 포트입니다. ★ 일레니엄 포트입니다. ★ ②

③

지역	종목코드	종목명	1개월 수익률	3개월 수익률	1년 수익률	AUM (\$Billion)	정보
미국(나스닥100)	TQQQ	iShares Core MSCI Emerging--	-22.22	42.47	32.27	274.87	Q
미국(나스닥100)	TQQQ	iShares Core MSCI Emerging--	-22.22	42.47	32.27	274.87	Q
미국(나스닥100)	SPY	SPDR S&P 500 ETF Trust	-22.22	42.47	32.27	274.87	Q
미국(나스닥100)	SVXY	ProShares Short VIX Short-Term--	-22.22	42.47	32.27	274.87	Q
미국(나스닥100)	TQQQ	iShares Core MSCI Emerging--	-22.22	42.47	32.27	274.87	Q

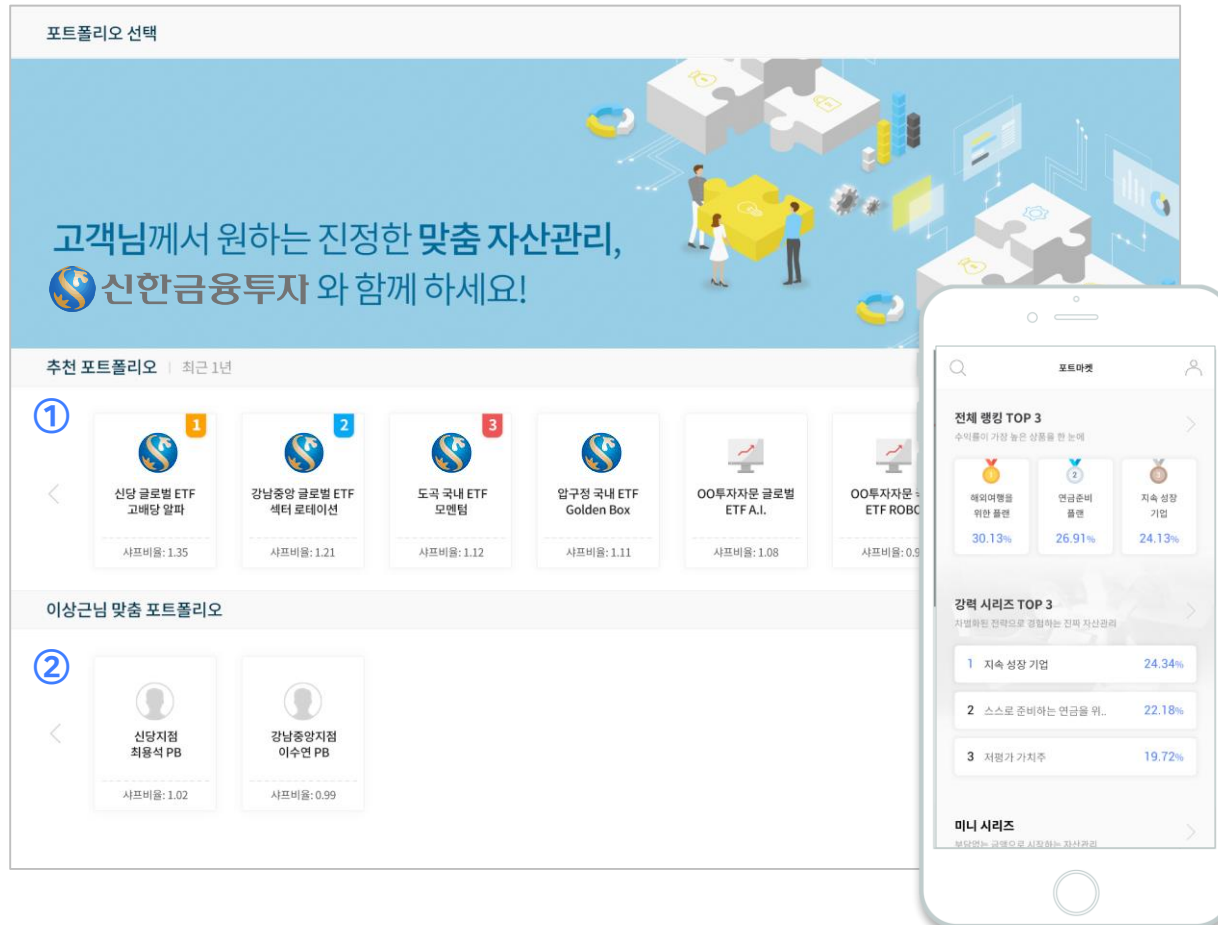
시뮬레이션

쉽고 간편하게
투자 전략을 만든다!

- ① 전세계 투자하고 싶은 투자상품을 선택
- ② 선택한 투자상품의 비중이 콤팩트 알고리즘을 통해 최적의 투자 비중으로 배분되면서 과거부터 현재까지 투자하고 싶은 상품들이 거둔 수익률을 확인
- ③ 여기에 다른 투자상품을 추가하거나 기존에 선택된 투자상품을 빼고 다시금 과거 수익률 확인 가능

3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

전문가가 만드는 생태계



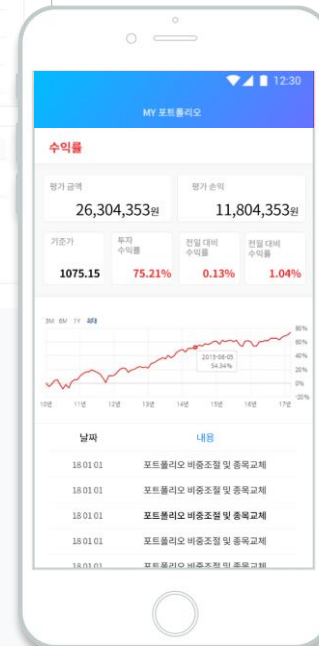
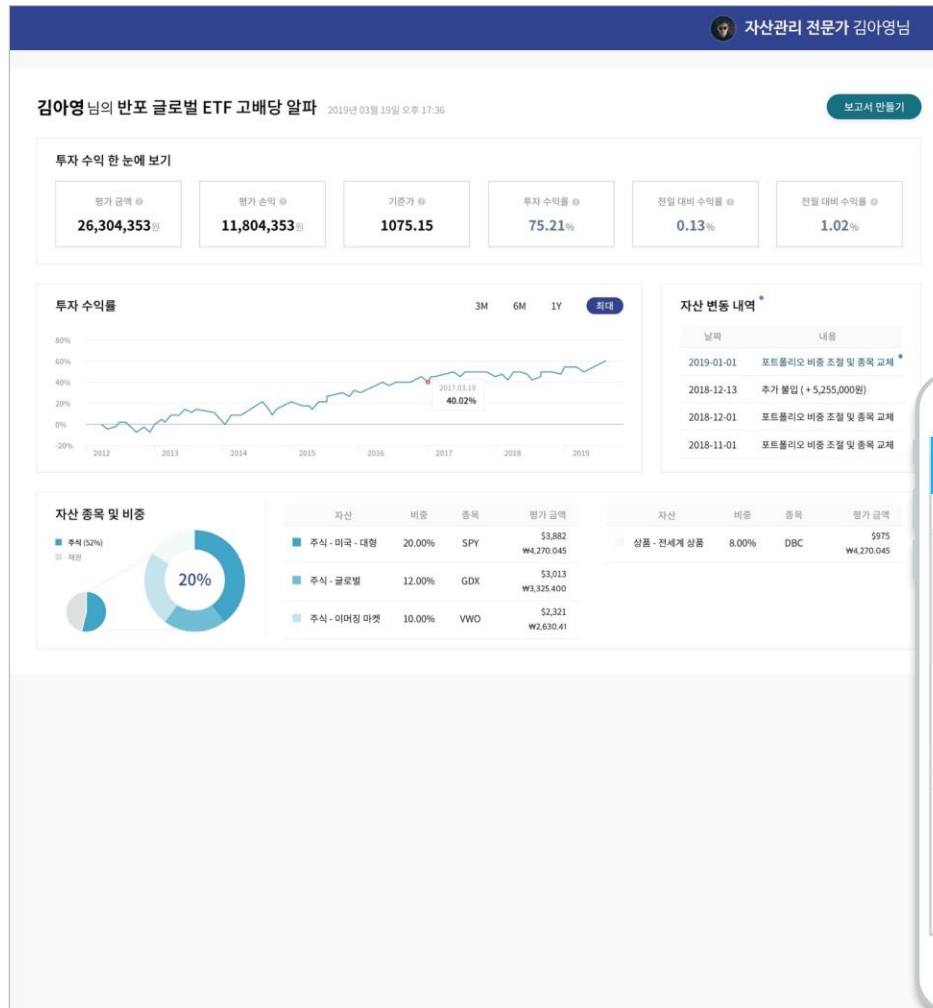
누구나 볼 수 있게
로보어드바이저를 판매!

- ① 판매하는 로보어드바이저를 고객이 원하는 옵션으로 랭킹을 매겨 확인
- ② 특정 고객별 맞춤 투자상품 제공

※ 특허출원 10-2018-0073826 '글로벌 자산배분 서비스와 그 장치' 외 2건 진행 중

3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

전문가가 만드는 생태계



내가 투자한 투자상품
온라인으로 확인하고 관리!

어떻게 투자되고 운영되고 있는지 상품 투
자 내역을 간편하게 웹 / 모바일 에서 관리

※ 특허출원 10-2018-0073826 '글로벌 자산배분 서비스와 그 장치' 외 2건 진행 중

3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

오프라인 소비자의 니즈



내 잔고 :  -14%

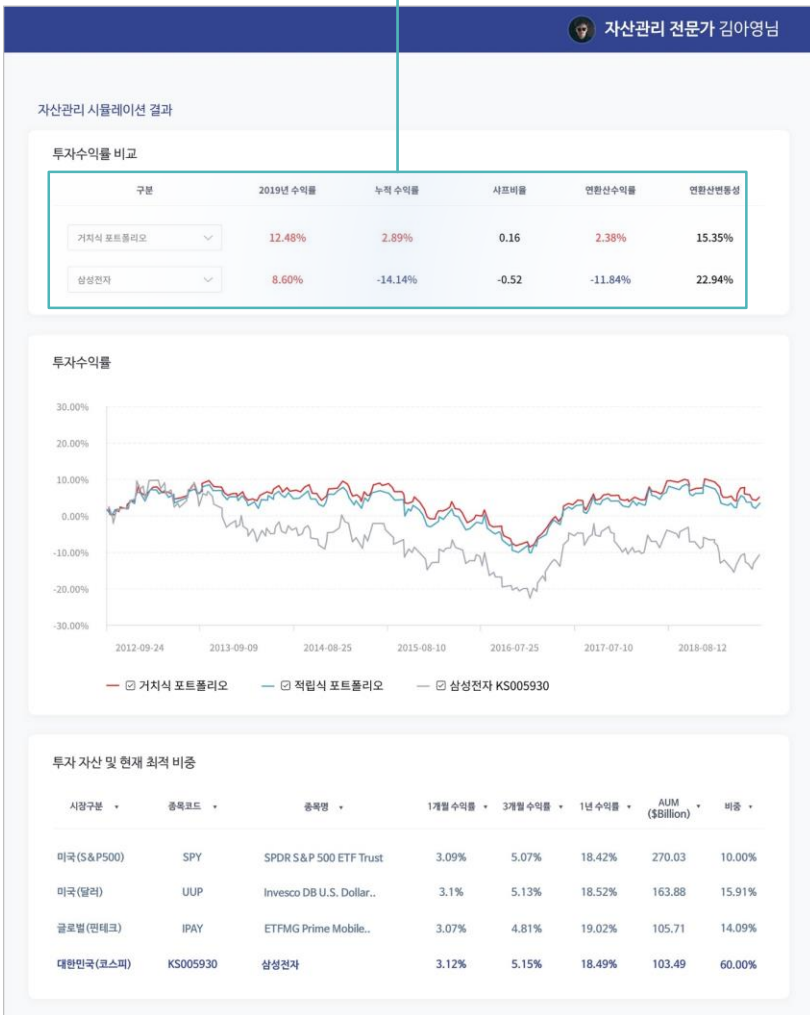
“도대체 이걸 어떻게 해야 하지...
하~ 전부 팔 수도 없고 무슨 방법이 없을까?”

“고객님,
지금 보유하고 있는 주식을 포함해
모두 팔지 않고 가능한
맞춤 포트폴리오를 추천 드리겠습니다!”



3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

소통과 대화로 맞춤 포트폴리오 설계



보유중인 삼성전자 40% 매도해
기존 보유 주식을 포함한 글로벌 ETF 포트폴리오 구성!

기존 100% 보유 시 -14%

글로벌 ETF와 포트폴리오 구성 했을 시 +2.8%

📢 최적 포트폴리오 시뮬레이션

포트폴리오 구성 시 벤치마크 (기존 보유주식 100%) 와 실시간
비교해 성과 평가 및 추천

📢 1:1 맞춤포트폴리오 제공

고객의 보유 주식을 일부 매도 하거나 추가 불입해
현재 보유주식을 포함, 글로벌 자산배분 맞춤 포트폴리오 생성

3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

소통과 대화로 맞춤 포트폴리오 설계



국내 주식과 글로벌 ETF를 조합해
고객이 원하는 최적의 포트폴리오 제공!

삼성전자만 100% 보유 시 -14%

글로벌 ETF와 포트폴리오 구성 했을 시 +20%



포트폴리오 리밸런싱 자동화

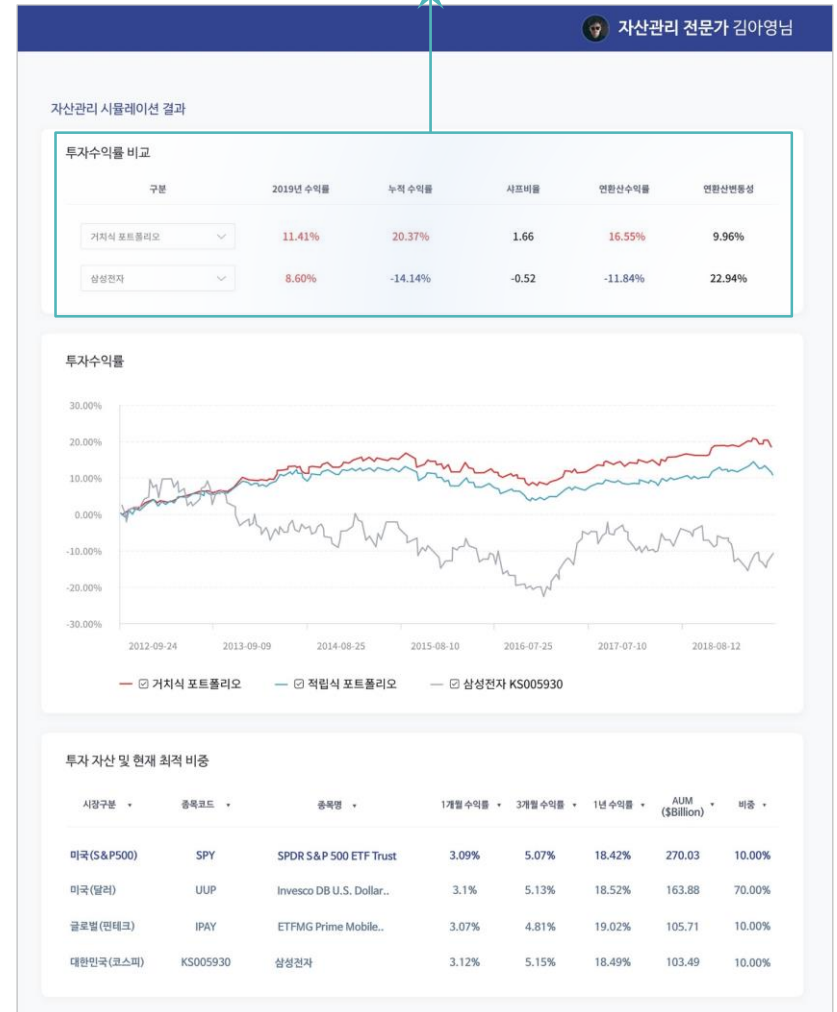
포트폴리오 구성 후 설정된 리밸런싱 주기와 시점 및 위험 설정
에 맞춰 자동으로 리밸런싱 진행



기본 포트폴리오 추천

PB가 상담을 통해 직접 구성하는 포트폴리오 외, 현재 시점에
간단히 고객에게 추천 가능한 기본 포트폴리오 탑재

구분	2019년 수익률	누적 수익률	샤프비율	연환산수익률	연환산변동성
거치식 포트폴리오	11.41%	20.37%	1.66	16.55%	9.96%
삼성전자	8.60%	-14.14%	-0.52	-11.84%	22.94%



3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

큐오스크 - 증권사 최초의 무인화 점포 솔루션



대학가, 지하철 역사 등 설치하여 계좌개설, 자산배분 포트폴리오, 구성 및 직원 연결 등이 가능한 “증권사 최초 무인화 점포 솔루션”

The illustration shows a series of kiosk screens displaying financial information and user interaction options. The screens are arranged in a row, with the first screen on the left showing a line graph and the last screen on the right showing a user interacting with the interface.

투자 초심자

고객님을 위한 자산관리 보고

누적 수익률 75.21% 전일 대비 수익률 0.13%

자산군 비율

자산군	비율
안전자산	75%
위험자산	25%

무로계좌개설

이제 계좌개설도 영업점 방문 없이, 무료로!

투자 초심자

혼자 하는 투자가 익숙하지 않으신 분들

투자 경험자

이미 투자를 해본 경험이 있으신 분들

영업직원 연결

투자에 대한 모든 궁금증을 해결해드립니다.

이전으로

투자 스타일을 알아볼까요?

원하는 투자 스타일에 따라 유형을 선택해보세요!
투자 유형에 따라 아래의 그래프가 변해요.

안전자산 75% 위험자산 25%

비율	금액
25%	25,000원
75%	75,000원
100%	100,000원

투자 초심자

고객님을 위한 자산관리 보고

누적 수익률 75.21% 전일 대비 수익률 0.13%

자산군 비율

자산군	비율
안전자산	75%
위험자산	25%

먼저 투자 스타일을 알

원하는 투자 스타일에 따라 유형을 선택해보세요!
투자 유형에 따라 아래의 그래프가 변해요.

안전자산 75% 위험자산 25%

당신이 찾던 진짜 자산관리

관객과 함께 시작하세요

시작하기

다음

주문연결 **출력하기**

다음

Quantec

3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

오프라인에서 증명되는 아이라 사용자의 니즈

00증권 마케팅실 000차장

“**쉽고 직관적**이다. 영업점에서 활용하면 굉장히 좋을 것 같다.
상담 고객이 영업점 직원을 **정말 전문가처럼** 느낄 수 있을 듯 하다.”

00투자증권 지점 000과장

“**고객을 설득**하고 상품 판매가 너무 편해질 것 같다.
내게 수수료가 많이 떨어지면 무분별하게 상품을 파는게 아닌
고객이 원하는 맞춤 포트폴리오에 실시간으로 확인까지 가능하니...”

00금융투자 지점 000팀장

“로보 어드바이저는 우리 일자리를 빼앗는 적대적인 관계로 생각했다.
그런데 내가 **직접 로보 어드바이저를 만들어** 상담하고 **온라인으로 판매**까지 할 수 있다니...
상상도 못 했다.”

00투자증권 지점 000 PB

“이거 **우리만 독점**으로 사용하게 해줬으면 좋겠다.”

3. 금융의 미래 “머니포트” & “아이라”

관택의 운용전략의 차별성

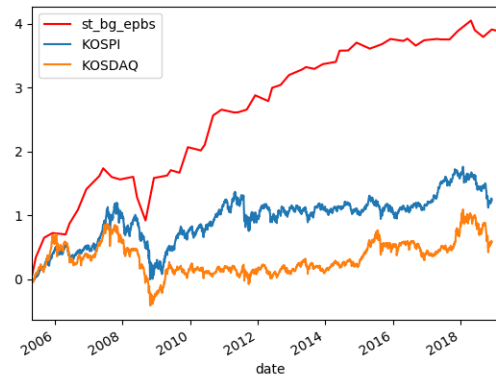
개념

기업 시가총액이 작을 수록, 기업 가치가
저평가 될 수록 수익률이 우수하다는
파마 & 프렌치의 논리

방법론

1. 시가총액 하위 20%
2. PBR 0.2 이상
3. PBR이 가장 낮은 10개 종목
4. 분기 단위 정기 리밸런싱
5. 상시 실시간 관리

국내



해외 (Universe S&P 500)



기준일 : 2019.05

“단순하고 간단한 설명일수록 올바른 것일 확률이 더 높다”

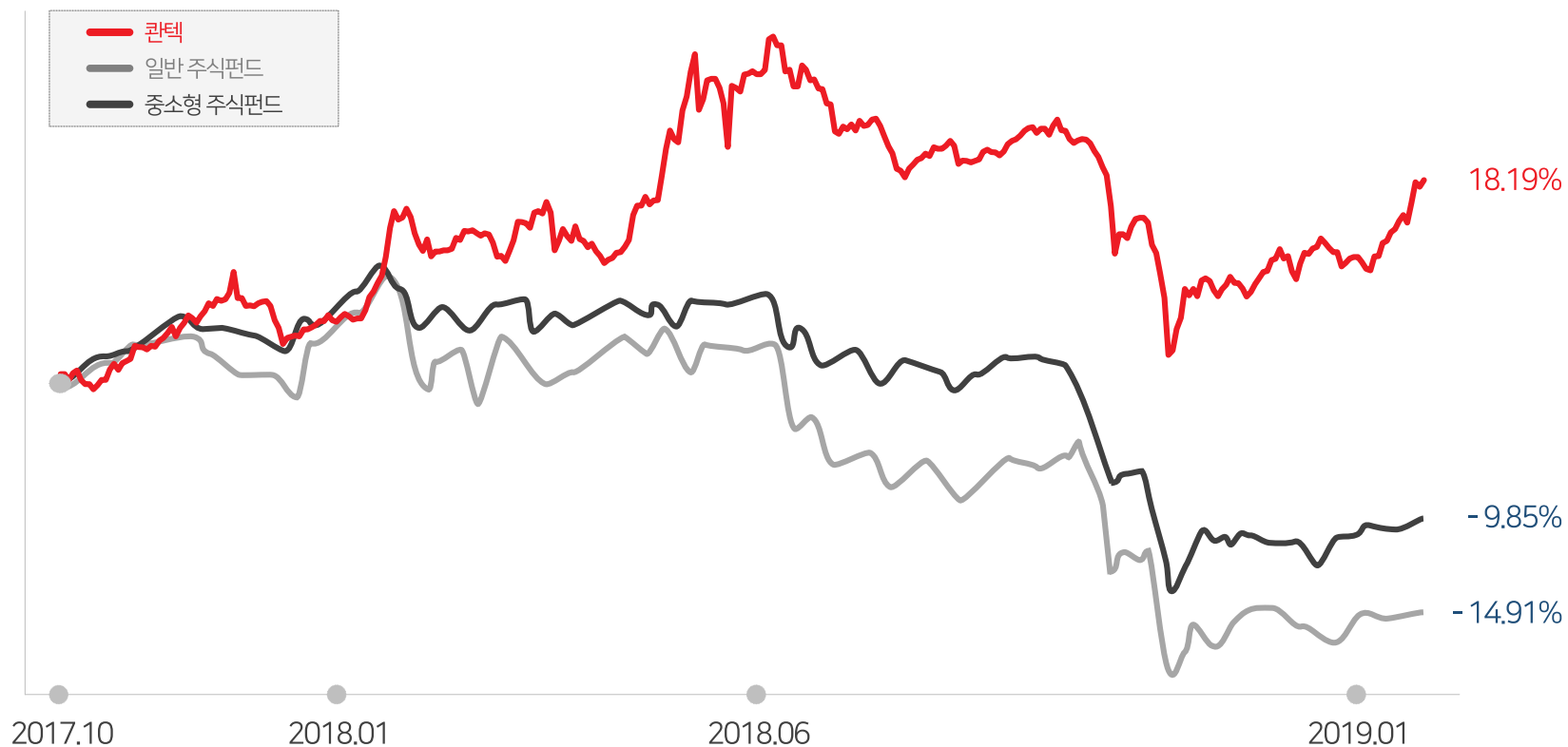
존 보글 (뱅크드 설립자)



S 증권사에서 운용한 9개 “국내 주식 운용전략” 평균 성과

19.01.23 기준 1326개 펀드 중 1등

MASS 고객을 타깃해 “1개 운용전략 당 150만원”으로 스트레스 테스트 통과



금융위원회 주관 운용전략 공개 테스트 참가

관텍 & S 증권사 컨소시엄, 6개 운용전략 (20.03.25 기준)

국내 모든 증권사, 은행, 자산운용사, RA업체 포함
관텍이 가장 많은 운용전략 공개 및 최초 100만원으로 가능한 해외 주식 포트폴리오



RA 테스트베드 운영현황

RA 테스트베드 사무국 발표 (20.03.05 기준)

금융위원회 주관 코스콤 RA 테스트베드는
로보 어드바이저 투자 알고리즘의 견고성,
운용능력, 자동화 요건 등 까다로운 심사
절차를 거쳐 **실사용 가능한 알고리즘**에
'로보 어드바이저' 단어 사용과
비대면 일임 자격을 부여

관텍의 6개 투자 알고리즘은 금융위원회로
부터 **서비스 상용화 자격** 부여

국내 로보 어드바이저 업체 중
비대면 일임이 가능한 알고리즘 전략 **최다**
보유 업체로, 비대면 일임 앱에서 경쟁적
우위를 점할 수 있음

(이하 NH투자증권 4개, 대신증권 4개, 미래에셋대우 4개,
KB국민은행 3개, 키움증권 3개 순)

2020년 2월 로보어드바이저 테스트베드 운영현황

2020. 3. 5, RA 테스트베드 사무국

① 기간별 수익률 Top 10 RA

6M			(2019.9.1~2020.2.29)		
순위	알고리즘	수익률	순위	알고리즘	수익률
①	신한-관텍 가치투자 주식형 3호 [적극투자] 신한금융투자	24.54	⑥	QV 연금포트폴리오 [적극투자] NH투자증권	6.61
②	신한-관텍 가치투자 주식형 3호 [위험중립] 신한금융투자	11.95	⑦	QV-ISAAC 자산배분 펀드형 [적극투자] NH투자증권	6.23
③	신한-관텍 가치투자 주식형 2호 [적극투자] 신한금융투자	10.07	⑧	KB_케이봇샘_국내 [적극투자] KB국민은행	5.61
④	파운트 블루웨일(펀드)1.0 [적극투자] 파운트투자자문	7.36	⑨	KB_케이봇샘_해외 [적극투자] 데이터앤애널리틱스	5.49
⑤	신한-관텍 가치투자 주식형 3호 [안정추구] 신한금융투자	7.29	⑩	QV 연금포트폴리오 [위험중립] NH투자증권	5.48

1Y			(2019.3.1~2020.2.29)		
순위	알고리즘	수익률	순위	알고리즘	수익률
①	쿼터백 글로벌자산배분 해외상장ETF [안정추구] 쿼터백자산운용	17.39	⑥	쿼터백 글로벌자산배분 해외상장ETF [적극투자] 쿼터백자산운용	15.01
②	QV 글로벌 자산배분 [위험중립] NH투자증권	16.98	⑦	신한-관텍 가치투자 해외주식형 2호 [안정추구] 신한금융투자	14.30
③	쿼터백 글로벌자산배분 해외상장ETF [위험중립] 쿼터백자산운용	16.02	⑧	신한-관텍 가치투자 주식형 2호 [적극투자] 신한금융투자	13.67
④	키움 멀티에셋 [적극투자] 키움증권	15.47	⑨	디셈버 다이렉트 ETF 해외형 [안정추구] 미래에셋대우	12.31
⑤	신한-관텍 가치투자 주식형 3호 [적극투자] 신한금융투자	15.33	⑩	신한-관텍 가치투자 해외주식형 1호 [안정추구] 신한금융투자	12.19

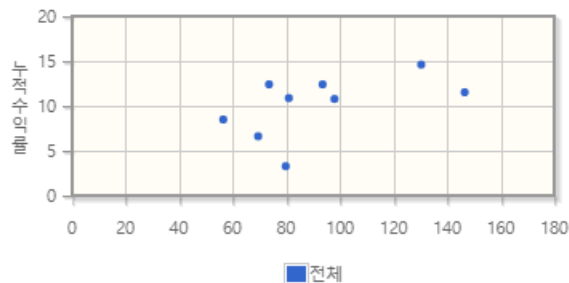


해외자산

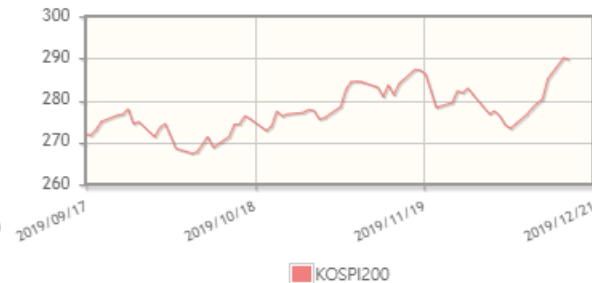
평균대비분석



매매회전을 vs 누적수익률



기준가



그룹 나누기

그룹 모으기

☐ 전체그룹

☒ R* 그룹

☐ R+ 그룹

☐ R! 그룹

■ R* 그룹 (테스트베드를 통과하여 상용서비스가 가능한 알고리즘으로 9개의 포트폴리오가 공시되고 있습니다.)

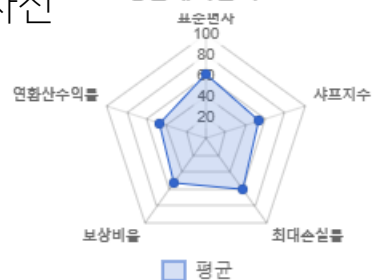
운용기준일 : 2019년 12월 17일

알고리즘명 [계좌별명]	업체명	수익률(%)				위험지표				참고지표					운용시작일	그래프 보기
	운용자금(원)	1주	1개월	연환산	누적	표준 편차	샤프 지수	최대 손실률	보상 비율	자산 위험도	유형 차별성	종목 편중률	다계좌 운용	구성 종목수	운용기간	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외4-9호]	신한금융투자	0.09	3.02	17.52	14.61	0.17	0.94	-9.50	1.33	9.44	6.44	10.62	-	11	2019-02-11	▶
	620,000														0.8년	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외4-6호]	신한금융투자	-0.50	2.06	14.36	12.40	0.08	1.57	-4.00	2.72	7.45	6.44	46.83	-	12	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외4-3호]	신한금융투자	-0.82	1.47	13.92	12.40	0.05	2.28	-3.90	2.79	6.44	6.44	64.39	-	12	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외6-9호]	신한금융투자	-1.82	-3.45	5.81	3.27	0.16	0.26	-8.25	0.36	9.36	7.25	9.68	-	11	2019-02-11	▶
	620,000														0.8년	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외6-3호]	신한금융투자	-1.41	-0.50	9.86	8.48	0.06	1.34	-3.76	2.00	6.32	7.25	66.71	-	12	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외6-6호]	신한금융투자	-1.56	-1.44	8.34	6.61	0.08	0.82	-3.74	1.60	7.23	7.25	49.37	-	12	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외5-9호]	신한금융투자	-0.93	2.21	14.06	11.52	0.14	0.90	-7.09	1.44	9.02	7.56	9.74	-	11	2019-02-11	▶
	620,000														0.8년	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외5-3호]	신한금융투자	-1.14	1.22	12.21	10.87	0.06	1.82	-4.13	2.32	6.28	7.56	65.28	-	12	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관텍 가치투자 해외주 [신한금융투자해외5-6호]	신한금융투자	-1.06	1.61	12.45	10.77	0.07	1.48	-3.72	2.58	7.18	7.56	47.52	-	12	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	

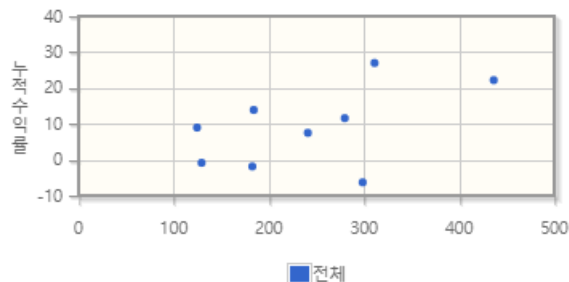


국내자산

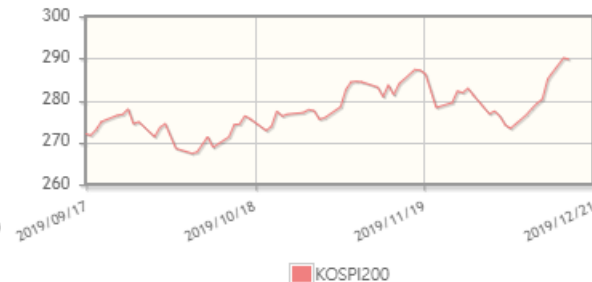
평균대비분석



매매회전을 vs 누적수익률



기준가



그룹 나누기

그룹 모으기

☐ 전체그룹

☒ R* 그룹

☐ R+ 그룹

☐ R! 그룹

R* 그룹 (테스트베드를 통과하여 상용서비스가 가능한 알고리즘으로 9개의 포트폴리오가 공시되고 있습니다.)

운용기준일 : 2019년 12월 17일

알고리즘명 [계좌별명]	업체명	수익률(%)				위험지표				참고지표					운용시작일	그래프 보기
	운용자금(원)	1주	1개월	연환산	누적	표준 편차	샤프 지수	최대 손실률	보상 비율	자산 위험도	유형 차별성	종목 편중률	다계좌 운용	구성 종목수	운용기간	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내3-9호]	신한금융투자	5.95	1.40	29.96	26.97	0.25	1.13	-15.41	1.35	8.69	7.09	9.97	-	10	2019-02-11	▶
	620,000														0.8년	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내3-3호]	신한금융투자	1.86	0.53	10.69	8.95	0.08	1.20	-4.84	1.69	4.05	7.09	65.64	-	11	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내3-6호]	신한금융투자	3.05	0.80	16.39	13.87	0.13	1.15	-8.47	1.42	5.32	7.09	49.34	-	11	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내1-9호]	신한금융투자	-0.10	-2.25	-7.92	-6.32	0.13	-0.01	-15.98	-0.36	8.38	6.54	11.95	-	11	2019-02-11	▶
	620,000														0.8년	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내1-3호]	신한금융투자	-0.03	-0.62	-1.07	-0.88	0.04	-0.00	-4.58	-0.18	4.09	6.54	66.99	-	12	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내1-6호]	신한금융투자	-0.02	-1.11	-2.37	-1.89	0.07	-0.00	-8.22	-0.22	5.53	6.54	46.86	-	12	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내2-3호]	신한금융투자	1.00	-0.65	8.29	7.48	0.09	0.75	-6.43	1.07	4.04	6.90	66.53	-	11	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내2-9호]	신한금융투자	3.10	-2.65	23.03	22.18	0.29	0.73	-19.98	0.88	8.74	6.90	10.03	-	10	2019-02-11	▶
	620,000														0.8년	
R* 신한-관택 가치투자 주식형 [신한금융투자국내2-6호]	신한금융투자	1.69	-1.28	12.57	11.58	0.15	0.73	-10.76	0.95	5.51	6.90	45.78	-	11	2019-02-11	▶
	2,010,000														0.8년	

관텍 글로벌 알고리즘 모델

관텍투자자문(예정)의 매크로 퀀트 모델 전략

01 기본팩터모델

- 퀀트 전략의 일종인 팩터 모델 사용
- 각각의 스타일을 가진 재무 팩터를 활용하여 주식 전략의 분산화
- 전략별 상관계수를 통한 유사전략 제외 및 전략 확정

02 매크로 유사도 측정

- KOSPI 지수, 환율, PMI, 채권 이자율 등 다양한 변수를 통한 매크로 상황 측정
- 유클리드 거리를 변형한 측정 방법으로 각각의 시점과 유사한 매크로 시점 확인
- 유사도 수치에 따라서 투자비중 결정

03 시장 상황에 맞춘 자산배분

- 현재 매크로 시장과 유사한 과거 매크로 시장 상황 탐색 (유사도 계산)
- 전략별 상관계수 분석 및 클러스터링 알고리즘을 통한 전략의 확정
- 매크로 유사도 수치와 해당시점의 전략별 수익률에 따라서 전략비중을 동적으로 결정

금융의 미래, 자산관리 마켓 서비스

머니포트 

최고 수준의 금융 투자 상품 개발 능력이 합쳐진
자산관리 마켓 서비스 제공으로 글로벌 미래 금융을 선도 하겠습니다.

Contact us

서울특별시 영등포구 여의대로 14, KT타워 14층 관텍 주식회사

sglee@quantec.co.kr

010-4537-8266

