

## Online Live 강좌

### Python으로 배우는 딥러닝 시계열 예측\_Express

- ✧ 일정 2020년 11/25~12/23, 수요일 19:30-21:30(2시간씩 5회)
- ✧ 장소 **Online Live (Zoom을 이용한 화상 강의)**
- ✧ 비용 27.5만원
- ✧ 강사 한창호, 콰트글로벌 대표 / 경제학박사
- ✧ 신청 <https://www.quantglobal.co.kr/>
- ✧ 기타 이메일로 강의 자료 및 연결 URL을 강의 시작 전에 발송  
업무에 적용 가능한 소스코드 제공, 강의 녹화 동영상 제공
- ✧ 문의 crm@quantglobal.co.kr, 02-761-8090

<강의 개요>

주차	내용
사전강의	머신러닝/인공신경두뇌망/시계열분석 입문 동영상강의(각 5시간) 제공
WEEK 1	시계열 입문
	1) 데이터 종류 2) 정주성 개념 3) 기본 시계열모형 종류 4) 시계열 모형 특징 분석
WEEK 2	DNN 입문
	1) Python을 이용한 시계열 데이터 생성 실습 2) DNN(심층인공신경망) 구조 및 특징 설명, 예측 모형 코딩 실습 3) nnet-ts 패키지로 <b>일변량 시계열 일기간 예측 모형 설계 및 실습</b> <b>한국석유공사 통계자료 이용한 월별 국내 휘발유 수요 예측</b>
WEEK 3	RNN 을 이용한 시계열 예측
	1) RNN 정의 및 특징 설명 2) Keras 패키지로 <b>다변량 입력-일변량 예측</b> 모형 설계 및 실습 3) Nesterov Momentum 설명 ■ <b>싱가폴 자동차 보유허가증 데이터 이용한 경매 낙찰가격 예측</b>
WEEK 4	LSTM 을 이용한 시계열 예측
	1) LSTM 정의 및 특징과 RNN과의 차이점 설명 2) Keras, Tensorflow를 이용한 <b>다기간 기억 예측</b> 모형 설계 및 실습 ■ <b>통신사 전파 장애 야기하는 태양 흑점 활동 예측</b>
WEEK 5	다변량 예측
	1) Feature Engineering 기법 설명 2) Keras, Tensorflow 를 이용한 <b>다변량 예측</b> 모형 설계 및 실습 ■ <b>FSTE100, DowJones Industrial Index 지수변동성 예측</b>

### <실습 데이터 설명>

- 한국석유공사 월별 휘발유 소비 데이터: [www.petronet.co.kr](http://www.petronet.co.kr), 2010.1~2019.2
- 싱가포르 자동차 등록권리(Certificate of Entitlement) 월별 경매 데이터: <http://jse.amstat.org/datasets/COE.xls>, 1990.8~2007.1
- 태양 흑점 데이터: 벨기에 왕립천문대(Royal Observatory of Belgium, Brussels)에서 제공하는 1749년 ~ 2018년의 270년에 걸친 태양흑점 월별 평균 데이터 활용
- FSTE100 : 영국 주가 지수
- DowJones Industrial Index : 다우존스산업지수

### <수업 대상>

- ① **시계열 예측을 실무에 적극 활용하시고 싶은 분**: 수요 예측, 경기 예측, 변동성 예측, 주가 예측 등
- ② **딥러닝 관련 학위 논문 작성 중이신 분**: 딥러닝 및 시계열 분석 전반에 걸친 조언을 수업시간과 휴식시간을 통해서 해드리고 개인적으로도 적극 도와드리겠습니다.
- ③ **전직 및 이직을 준비 중이신 분**: 인공지능, 데이터 사이언스 및 관련 분야에 대한 각종 정보와 전직 및 이직에 대한 조언을 해드리겠습니다.
- ④ **시스템 트레이딩 분야에 관심을 가지신 분**: 딥러닝을 이용한 시계열 분석 기법은 인공지능을 활용한 첨단 알고리즘 트레이딩 시스템 개발에 크게 기여할 수 있으므로 최근 딥러닝을 이용한 시계열 분석 방법론이 금융공학 분야에서 주목을 받고 있습니다. 강사의 오랜 경험을 공유하실 수 있습니다.
- ⑤ **금융공학, 계량경제학, 기계학습 분야에 조언이 필요하신 분**: 강사의 경험과 인적 네트워크를 활용하여 적극적으로 도와드리겠습니다.

**<일자별 세부 강의 내용>**

**WEEK 1> 시계열 입문**

I	강의 주제	강의 내용
1	시계열 입문	정주성 개념 및 의미, 기본 시계열 모형 구조, PACF 설명
2		ACF와 PACF를 이용한 시계열 모형 구분 방법

**WEEK 2> DNN 입문**

II	강의 주제	강의 내용
1	DNN 입문	Python을 이용한 시계열 데이터 생성 실습 DNN 개요, 특징, 구성요소 설명 scikit-learn 패키지 사용하여 MLP 구성 및 실습
2		데이터 전처리 방법 설명 nnet-ts 패키지 사용하여 일변량 일기간 예측 모형 구성 실습

**WEEK 3> RNN를 이용한 시계열 예측**

III	강의 주제	강의 내용
1	RNN	RNN 구조 및 작동원리, 모형 확장 및 데이터 전처리 방법 설명
2		Keras 이용한 RNN 모형 구성 및 다변량 입력-일변량 예측 실습

**WEEK 4> LSTM 을 이용한 시계열 예측**

IV	강의 주제	강의 내용
1	LSTM	LSTM 구조, 특징, 용도 설명
2		Keras와 Tensorflow 이용한 LSTM 구성 및 실습 Shuffling을 통한 모형 성능 향상 실습

**WEEK 5> 다변량 예측**

IV	강의 주제	강의 내용
1	다변량 예측	다변량 예측 모형 정의, 데이터 전처리 설명
2		Keras와 Tensorflow 이용한 다변량 예측 모형 설계 및 실습

## <용어 설명>

- 정주성 : Stationarity, 유의미한 시계열 분석이 가능하기 위해 데이터가 지켜야 할 조건으로 시계열 분석 시 반드시 알아야 할 개념
- 기본 시계열 모형 : AR, MA, ARMA 등
- DNN : Deep Neural Networks
- ACF: Auto-Correlation Function
- PACF : Partial Auto-Correlation Function
- MLP : Multi-Layer Perceptron
- RNN : Recurrent Neural Networks
- NARX : Nonlinear Auto-Regressive Network With Exogenous Inputs, 외생변수를 포함하는 시계열 모형으로서 시계열 모형과 구조화 모형의 장점을 결합한 모형
- LSTM : Long Short-Term Model, RNN 모형의 기억능력 보강한 모형으로 시각/음성 데이터 분석에 널리 활용됨
- Feature Engineering : 머신러닝 모형의 성능을 최대한 끌어낼 수 있도록 입력변수를 선택하고 튜닝하는 기법

## <ZOOM 설치 안내>

설치 파일 다운로드: 아래 URL 에서 회의용 Zoom 클라이언트 다운로드 후 설치

- <https://zoom.us/download>

## <강사 프로필>

한창호

### <주요 경력>

- 2008.06~현재 콰트글로벌 대표
- 2018.09~현재 고려대학교 기술경영전문대학원 겸임교수 (인공지능, 빅데이터 강의)
- 2015.10~2016.08 가톨릭대학교 산업수학센터 연구교수 (산업수학 프로젝트)
- 2011.03~2015.09 가톨릭대학교 수학과 겸임교수 (계량경제학, 수리금융 강의)
- 2013.03~2015.08 성균관대학교 경영대학 겸임교수 (금융공학 강의)
- 2004.10~2008.06 삼성금융연구소 (자본시장통합법, 지급결제, 한-미 FTA, 전자금융)
- 2001.3~2004.10 (주)한국기업평가 (리스크관리 컨설팅, BASEL II 컨설팅,  
구조화금융상품 및 벤처기업 신용평가)
- 1999.12~2001.3 에너지경제연구원 (국제유가 전망 및 동향 분석, WTO 에너지 서비스 협상)
- 1999 University of California, San Diego, 경제학 박사 (계량경제학 전공)
- 1991 서울대학교 대학원 졸업, 경제학 석사
- 1989 서울대학교 경제학과 졸업, 경제학 학사

### <주요 학술 저술>

- "The DNA of Security Return", Quantitative Finance, vol.15, no.1, pp. 1-17. 2015.
- "수익률 DNA를 이용한 금융시장 분석 방법론", 자산운용연구, vol 2, no.1, pp 82-106, 2014.
- "Measuring the Dependency between Securities via Factor-ICA Models", Journal of Applied Finance and Banking, vol. 4, no. 1, 2014.
- "금융경쟁력 결정요인에 대한 실증연구", 국제경제연구, Vol. 13, No.3, pp. 53-75, 2007.
- "NAFTA와 외환위기 이후 멕시코 금융산업", 라틴아메리카연구, Vol II, No. 1, pp. 55-79, 2007.
- 기업신용위험분석, 금융연수원, 2002.
- "Multi-Variate Estimation and Forecasting with Artificial Neural Networks", 박사학위논문, UCSD, 1999.
- "비모수적 분포무관인 구조변화 검증통계량", 석사학위논문, 서울대학교, 1991.