

Strictly Confidential



Blue Cloud Asset Management

본 자료에 포함된 투자구조를 포함한 모든 정보의 권리는 당사에 있으며, 이와 관련하여 당사와 사전협의 없이 외부유출 및 도용을 금지합니다. 수록된 내용은 신뢰할 만한 자료나 정보로 작성된 것이나 당사는 그 정확성이나 완전성에 대하여 보장하지 아니하며, 어떠한 경우에도 법적 책임 소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다.

No.1 Algorithm Trading System Company
Blue Cloud Asset Management

Problem, Opportunity and Solution

PROBLEM

국내 주식시장은 최근 몇년 동안 글로벌 시장의 여파로 급락과 급등을 반복하는 변동성을 보이고 있으며, 증권사들의 지수 전망과 예상이 무의미하다는 금융전문가들의 주식시장에 대한 비관론이 고개를 들기도 한다. 대외변수에 민감한 변동성 장세로 인해 투자자들은 주식과 펀드에 투자해서는 안정적인 수익률을 기대하기 힘들며, 은행예금은 저금리와 인플레이션으로 인해 이자수익률로는 물가상승률을 상회하기 어렵기 때문에 이미 오래전에 적합한 투자처로의 기능을 상실하였다.

OPPORTUNITY

그렇다면 변동성에 따른 대응책으로 안정적인 수익률 창출과 저금리와 물가상승률을 이길 수 있는 투자전략과 대안은 어떤 것이 있을까?

SOLUTION

Blue Cloud Asset Management (BCAM)에서는 최근의 시장상황에 가장 적합한 투자전략으로 해외 CTA 트레이딩 플랫폼을 활용한 Blue Cloud Futures Algorithm Trading System (BFATS)전략으로 절대수익의 가능성을 제시한다.

1. Core Strategy

Blue Cloud Futures Algorithm Trading System (BFATS)

POWERFUL ALGORITHM

- ❖ Blue Cloud Asset Management의 파트너 Delta Exchange Group이 오랜 기간 축적된 기술과 경험을 바탕으로 자체 개발한 SkyDelta Trading Program (SDTP)를 사용하여 객관적이며 신뢰도 높은 단기 알고리즘 기반 트레이딩 시스템을 구축
- ❖ 단기 추세 추종 Algorithmic Trading Program 활용
- ❖ 강력한 통계분석과 컴퓨팅 기술을 이용한 자체개발 트레이딩 플랫폼 활용

LOW LATENCY

- ❖ 축적된 기술을 바탕으로 가장 효과적이고 빠른 조회 및 체결 시스템 구현기술 확보
- ❖ 다양한 시장에서 실전 검증된 자체 소프트웨어 성능의 높은 완성도

PRODUCT SCALABILITY

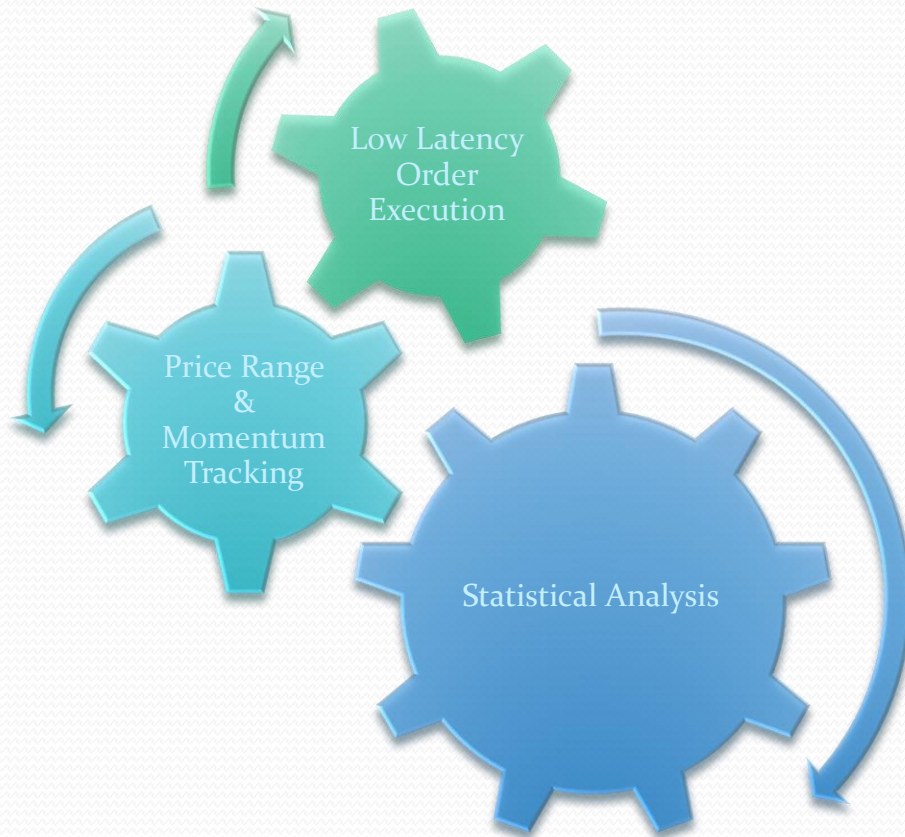
- ❖ 국제 파생상품 중개 등 증권사의 기존사업과 연계를 통한 시너지 효과
- ❖ 일정 기간 트랙 레코드 축적 이후 해외 CTA 연계 ELB등 리테일 고객 상품 개발 가능

GLOBAL REACH

- ❖ 다양한 시장특성의 CTA 전략에 맞추어 Intra-Day Algorithmic Trading 구사
- ❖ 해외상품을 대상으로 Absolute Return을 추구하는 해외 AI 운용 전략
- ❖ 객관적인 Algorithm을 기반으로 글로벌 시장에서 빠르고 넓게 투자하는 전략

2. What is BFATS?

BFATS Methodology



- ❖ 장기적인 경제 주기와 트렌드가 아닌 단기 (DAILY) 시장 변동성을 분석
- ❖ 시장의 방향이 아닌 시장 움직임의 폭과 모멘텀을 추적
- ❖ Analytical Computing 기술을 활용한 고유의 플랫폼으로 차별화된 전략을 구축하고 신속한 거래 체결
- ❖ 객관적이고 정확한 데이터를 기반으로 지속적으로 성과를 평가, 관리

3. Team

김홍식 대표이사 CEO

Education

1991-1995 University of Missouri- Columbia
경영학 박사 취득

1986 - 1991 New York University
경영학 박사과정 수료

1984 - 1985 University of Missouri - Columbia
경영학 석사 취득

1979 - 1983 한국 외국어 대학교
무역학과 학사 취득

Work

2013, 7 - 2016, 6 AGQ Capital Management, Chief Investment Officer
Managed Global Hedge Fund

2012 - 2013 현대증권, 전무
싱가폴 글로벌 헷지펀드 설립 태스크팀

2006 - 2011 K3 Capital Management, Chief Investment Officer, 창업파트너
아시아지역에 CB/BW 형태로 투자 운용

2004, 5 - 2006, 5 ABN Amro Bank, Hong Kong : Head of Asia Equity Linked Products
Group
아시아지역 CB세일즈 및 트레이딩 총괄

2002, 6 - 2004, 5 굿모닝 신한 증권 : 부사장(보)
파생상품 트레이딩 총괄

2001, 4 - 2002, 6 BNP Paribas Hong Kong : Managing Director
주식 파생상품 개발 및 세일즈

2001, 4 - 2002, 6 Commerzbank Securities Tokyo :
니케이 파생상품 / 기업금융 파생상품 개발 및 솔루션 제공

1997 - 1988 ING Baring Securities : Senior Equity Derivatives Marketer
1996 - 1997 Bankers Trust International
1995 - 1996 동양증권

강정환 수석투자책임자 CIO

Education

1993 Oxford, Trinity College
BA (Hons) Jurisprudence

1991 Oxford, Trinity College
BA (Hons) Modern History

Work

2006 - 2015 K3 Equity Partners, Seoul Korea : Director, Representative Director

2004 - 2005 ABN Amro Securities, Hong Kong : Global Head of Asian Distribution

2003 - 2004 Good Morning Shinhan Securities, London UK : Director
Institutional Equity Sales

2000 - 2002 Deutsche Bank Securities, London, UK : Director
Institutional Equity Sales

1996 - 2000 ING Baring Securities, Hong Kong
Institutional Equity Sales

1994 - 1996 Barclays de Zoeto Wedd, London, UK
Institutional Equity Sales

3. Team

이철재 수석기술책임자 CTO

Education

1993 UC Berkeley
M.S. /Ph. D. in Neuroscience 수료

1996 UC Berkeley
B.S. Neuroscience

Work

2008 - 2012 Quad Dimensions : 대표이사, 창업멤버
온라인 게임 및 게임 운영 시스템의 개발. 2009년에 넥슨과 합병. 2011년 넥슨 Tokyo증시 상장 (TYO: 3659)

2001-2006 0 to 7 : 대표이사, 창업멤버
온라인 육아 및 교육 정보 제공 서비스, 온라인 커머스, 유아동복 브랜드 개발/생/영업, 육아제품 생산 유통.
2012년 KOSDAQ 상장 (KOSDAQ:159508)

1997-2006 Innoco Inc. : 대표이사, 창업멤버 / Nitrostream Ltd. : 이사, 창업멤버
온라인 게이밍 시스템 개발과 운영. Flash authoring tool development.
Flash/Shockwave embedded communication protocol and stack development

1996-1997 Genesis Consulting : Consultant
Management Information Systems strategy development and implementation

윤기훈 수석운영책임자 CIO

Education

2011 연세대학교 법무대학원 법학석사 졸업

1995 한국외국어대 경제학과 졸업

Work

2014 -2016 에이브이자산운용 대체투자본부 부사장

2012 - 2013 R&D Investment Co. Ltd. 대표이사

2006-2012 현대중공업계열 하이자산운용 시본부장, 대체투자팀장

2002 -2006 마이애셋자산운용 상품개발, 마케팅 팀장

2001 - 2001 E삼성 아시아허브 기획팀장

2000 - 2000 이캐피탈 기획팀 과장

1997 - 2000 씨티그룹 씨티글로벌마켓증권 기획조정실 대리

1995 - 1997 하나금융투자 영업추진팀