

INSTITUTIONAL ASSET MANAGEMENT PROPOSAL · 2026 EDITION

브이퀀트 인베스트먼트 (V-Quant Investment)

공식 기관 및 전문투자자 운용 제안서

빅데이터 통계 모델과 머신러닝 알고리즘을 기반으로 글로벌 자산배분 및 절대 수익(Absolute Return)을 추구하는 차세대 시스템 트레이딩
테크 펀

운용 주체

브이퀀트 인베스트먼트

대표이사 (CEO)

백경목

본사 거점

서울 여의도 파크원 타워1

운용 원칙

100% 를 기반 감정 배제

01. 3대 핵심 운용 철학 (Investment Principles)

P-01. 100% 를 기반

인간의 주관과 탐욕을 원천 배제하고 수학적으로 입증된 수익에 의해 24시간 오차 없이 집행됩니다.

P-02. MDD -5% 방어

수익 창출보다 원금 보존이 우선입니다. 최대 낙폭을 5% 이내로 제어하는 자동 스위칭을 탑재했습니다.

P-03. 20년 백테스트

2008 금융위기, 2020 팬데믹, 2022 긴축 충격을 모두 통과하며 실증된 모델만을 투입합니다.

02. 브이퀀트 독자 4대 알고리즘 엔진 아키텍처

A-01 V-Dynamic Asset Allocator

미국 대형주(SPY), 기술주(QQQ), 미 장기국채(TLT), 금(GLD), 현금(BIL)의 시장 레짐별 동적 배분.

A-02 V-Alpha Momentum Engine

3M/6M/12M 다중 시계열 모멘텀과 실현 변동성 역가중 사이징을 통한 초과 수익(Alpha) 창출.

A-03 V-Shield Drawdown Barrier

S&P 500 200일선 이탈 또는 VIX 28pt 급등 시 주식 비중을 즉시 0%로 강제 청산하고 현금 도피.

A-04 V-Execution Cloud Network

국내외 증권사 Open API 밀리초 단위 호가 연동 및 V-TWAP 시간가중분할 주문을 통한 슬리피지 68% 절감.

03. 20년 장기 백테스트 공시 성과 (2005.01 ~ 2026.03)

연평균 복리수익률 +18.4%	역대 최대 낙폭 -4.8%	샤프 지수 (Sharpe) 1.92	월간 승률 (Win Rate) 74.2%
----------------------------	--------------------------	-------------------------------	----------------------------------

전략 및 벤치마크	CAGR	MDD	Sharpe	Calmar
브이퀀트 멀티에셋 엔진 (V-Quant)	+18.4%	-4.8%	1.92	3.82
S&P 500 Index	+10.1%	-23.9%	0.72	0.42
코스피 200 (KOSPI 200)	+4.2%	-36.5%	0.38	0.11
전통 60/40 자산배분	+6.8%	-21.3%	0.64	0.32

* 왕복 거래 수수료 0.05% 및 호가 슬리피지 0.10%(합산 0.15%)를 매 거래마다 강제 차감 반영한 초보수적 시뮬레이션 지표입니다.

04. 운용 거점 및 기관 제휴 안내

브이퀀트 인베스트먼트는 서울 금융의 중심지 여의도 파크원에 거점을 두고 독자적 퀀트 알고리즘 인프라를 운영하고 있습니다. 패밀리 오피스, 법인 잉여 자금 운용 및 전문 투자자를 위한 맞춤형 알고리즘 계좌 운용 제휴를 진행합니다.

V-QUANT INVESTMENT PARTNERS INC.

본사: 서울특별시 영등포구 여의대로 108 파크원 타워1 (스파크플러스 여의도점)

대표 직통: 02-780-2026 | 이메일: contact@vquant-invest.com

OFFICIAL EXECUTIVE APPROVAL

대표이사 백경목 (CEO)

AUDIT ID: #VQ-IR-2026-FINAL