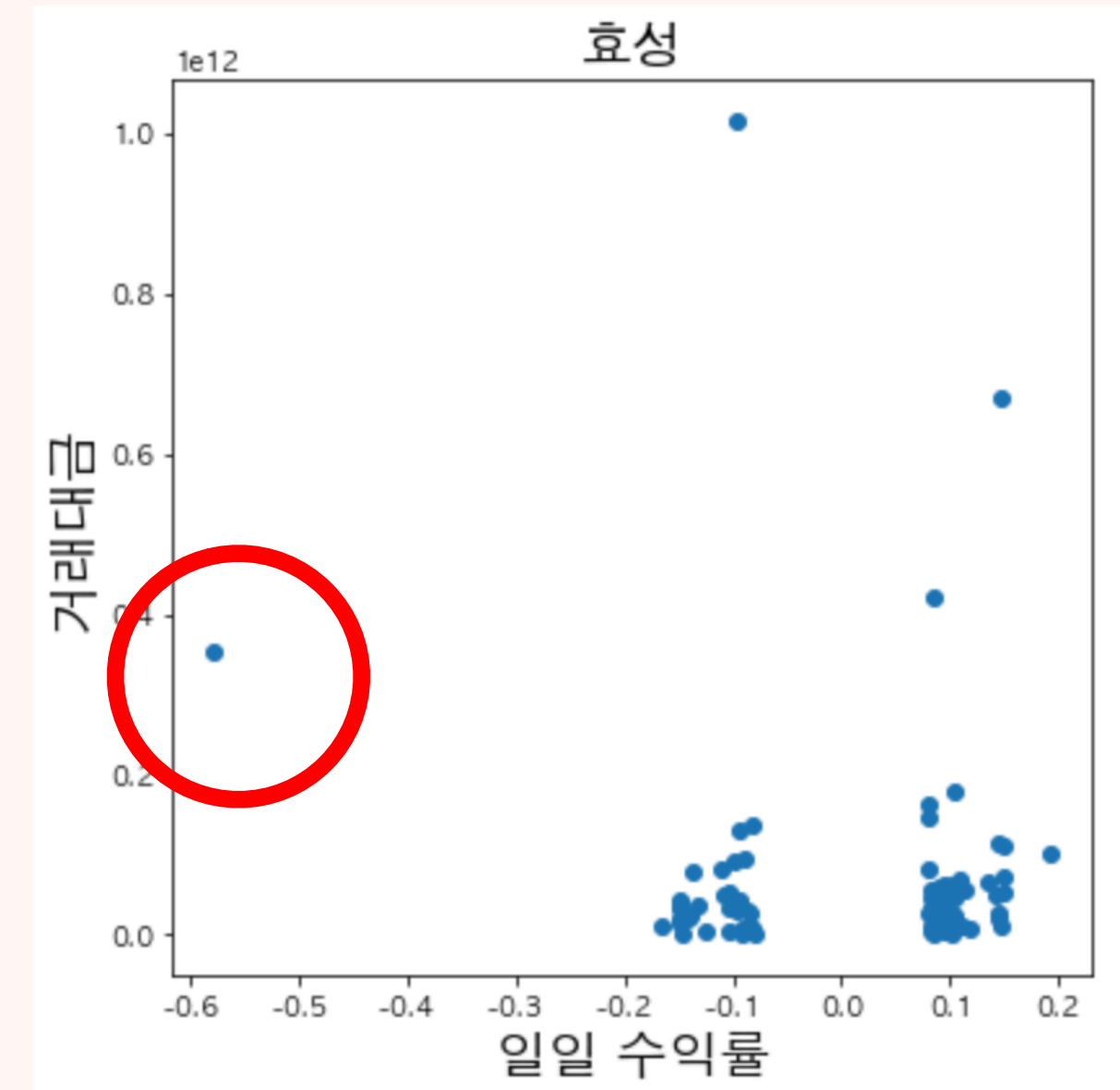
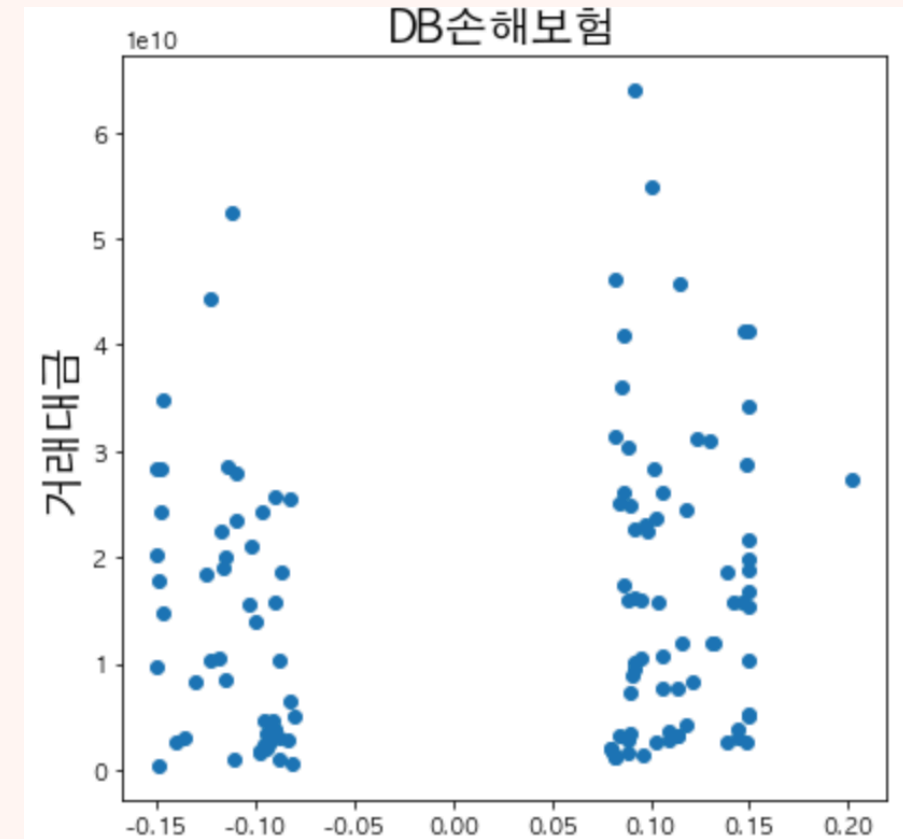
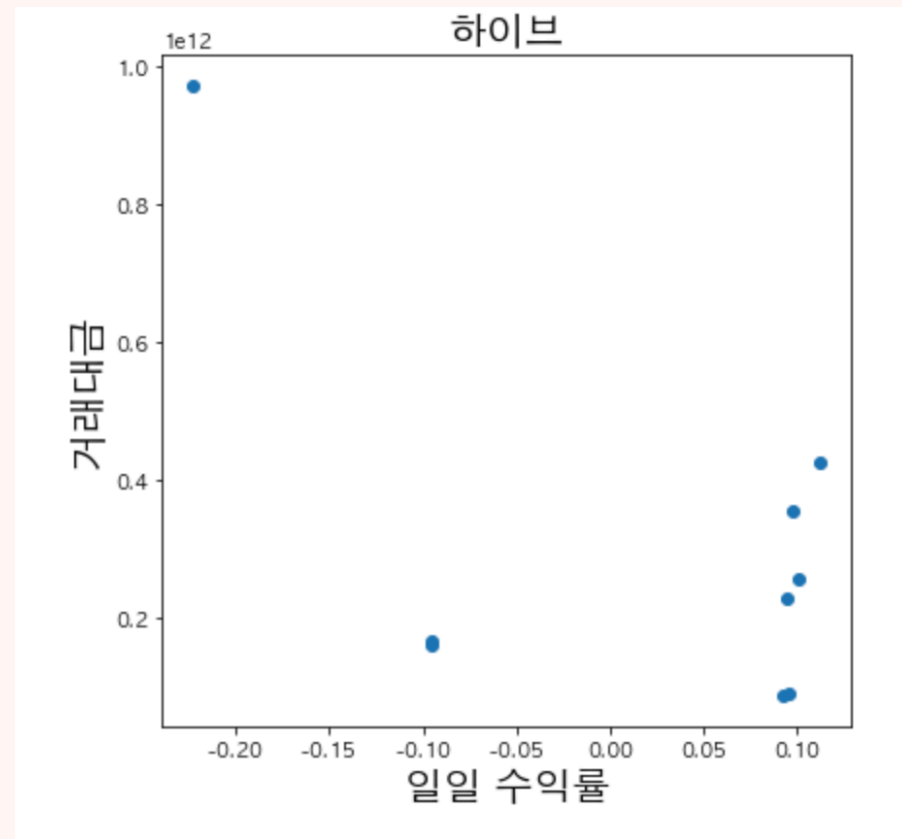

2022년 04월 08일

주식거래데이터 속 이상치 - 2

박현우



➤ 주식 일일 수익률의 절댓값이 클때 주식거래대금이
크는지 적은지 확인

➤ -0.6 의 일일 등락률 -> 액면분할효과

➤ 수정 주가를 사용하지 않아서 발생하는 일

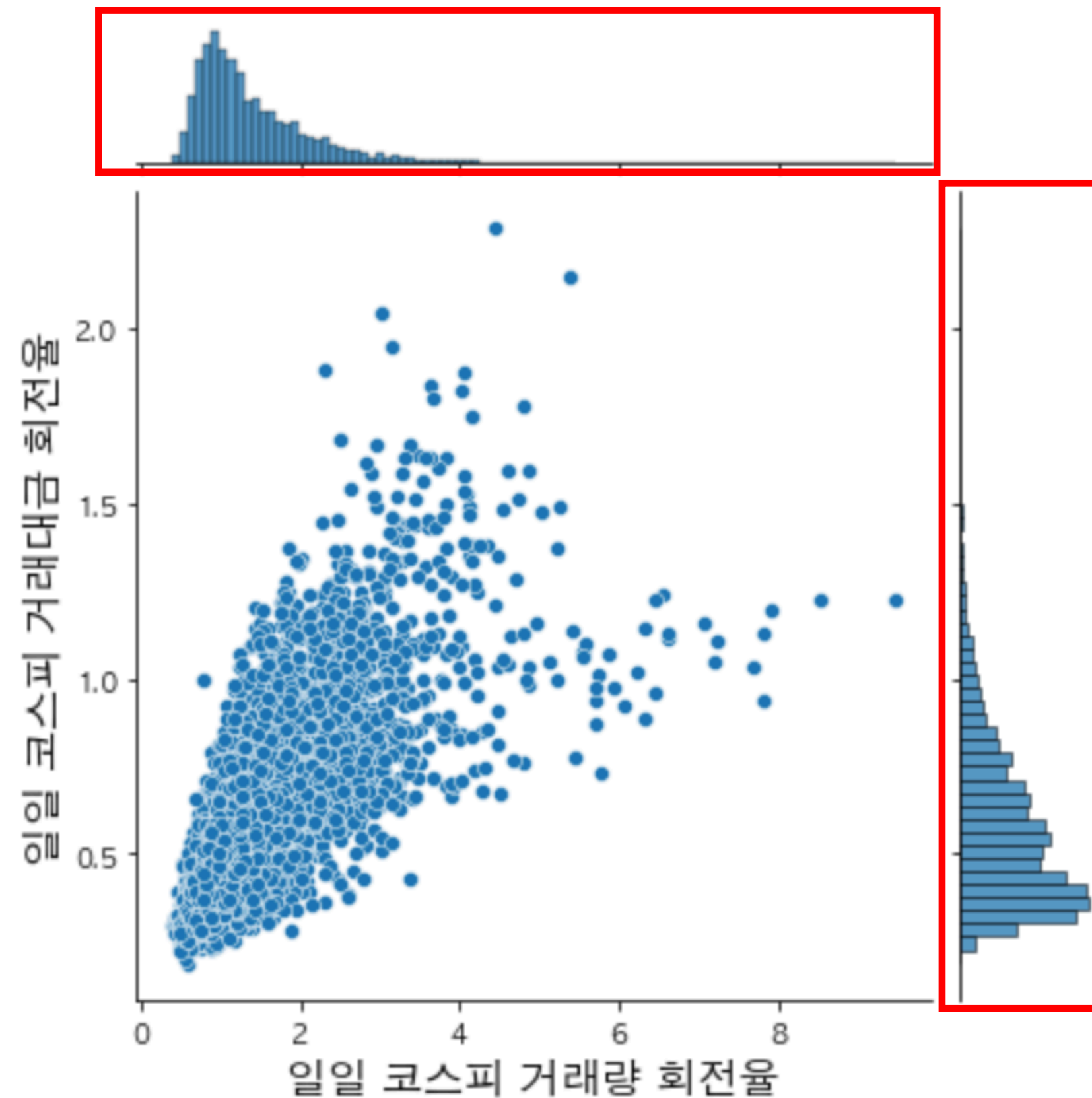
➤ 액면분할 시점도 기업에 있어서는 중요한 일이라고 판단됩니다
-> 수정주가를 사용해야하는지 궁금합니다.

코스피시장과 상대적 비교

- 포트폴리오 이론에서 사용하는 베타처럼 시장과 개별 종목사이 상대적 비교를 할 수 있는 지표가 필요함
 - 종목 거래량 / 코스피시장 거래량 문제점: 시가총액을 반영하지못함
 - 일일 거래량 회전율 (거래량 / 상장주식수) , 코스피 일일 거래량 회전율 (총 거래량 / 총 상장주식수)
 - 추가 개선안 : 대주주 지분 추가 제외
 - 종목 거래대금 / 코스피시장 거래대금 문제점 : 거래량과 동일하게 시가총액을 반영하지 못함
 - 일일 거래대금 회전율 (거래대금 / 시가총액) , 코스피 일일 거래대금 회전율(총 거래대금 / 총 시가총액)
-

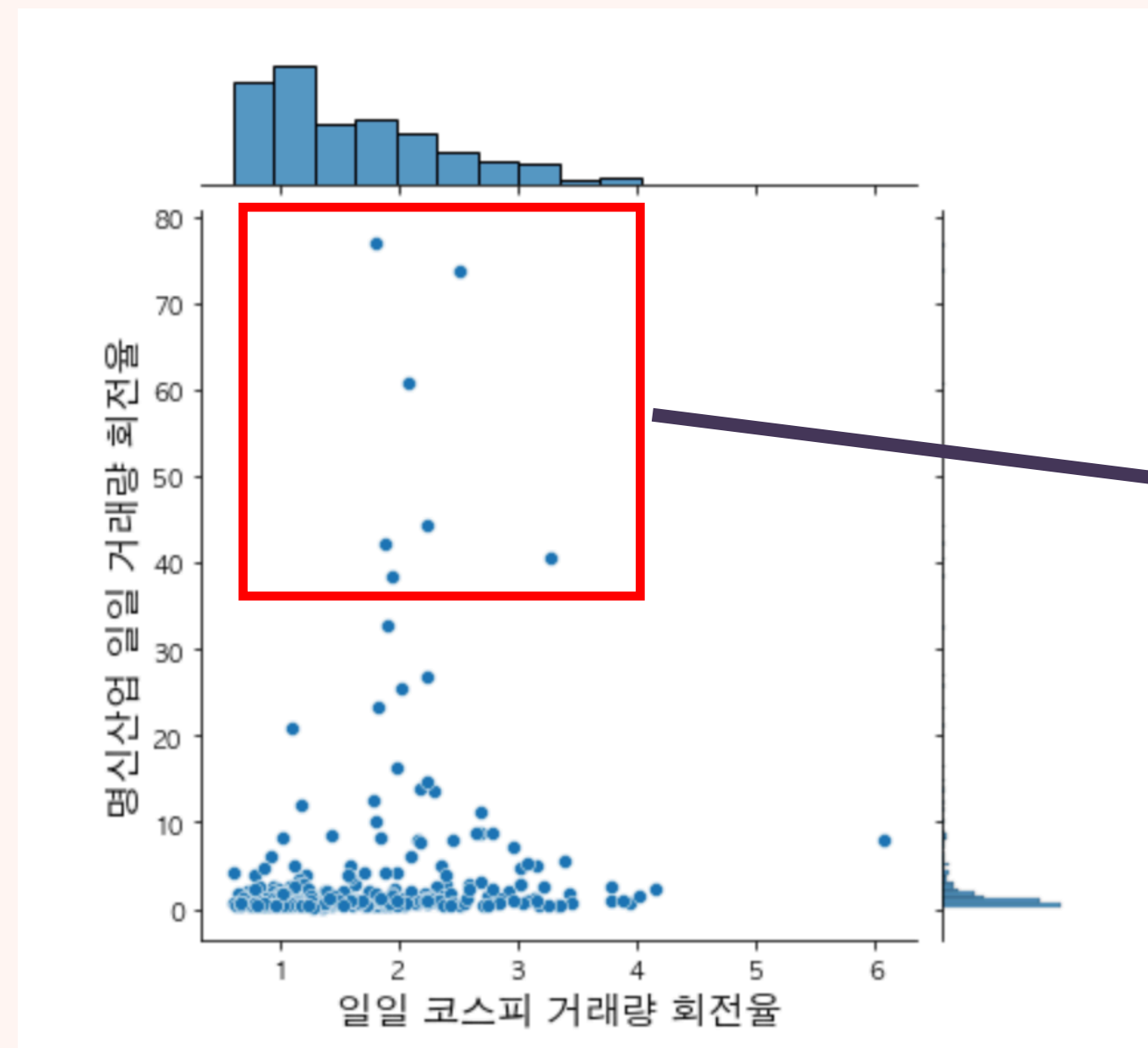
코스피 거래량회전율 거래대금회전율 관계

코스피 거래대금회전율 거래량회전율 상관관계 0.731222172082131

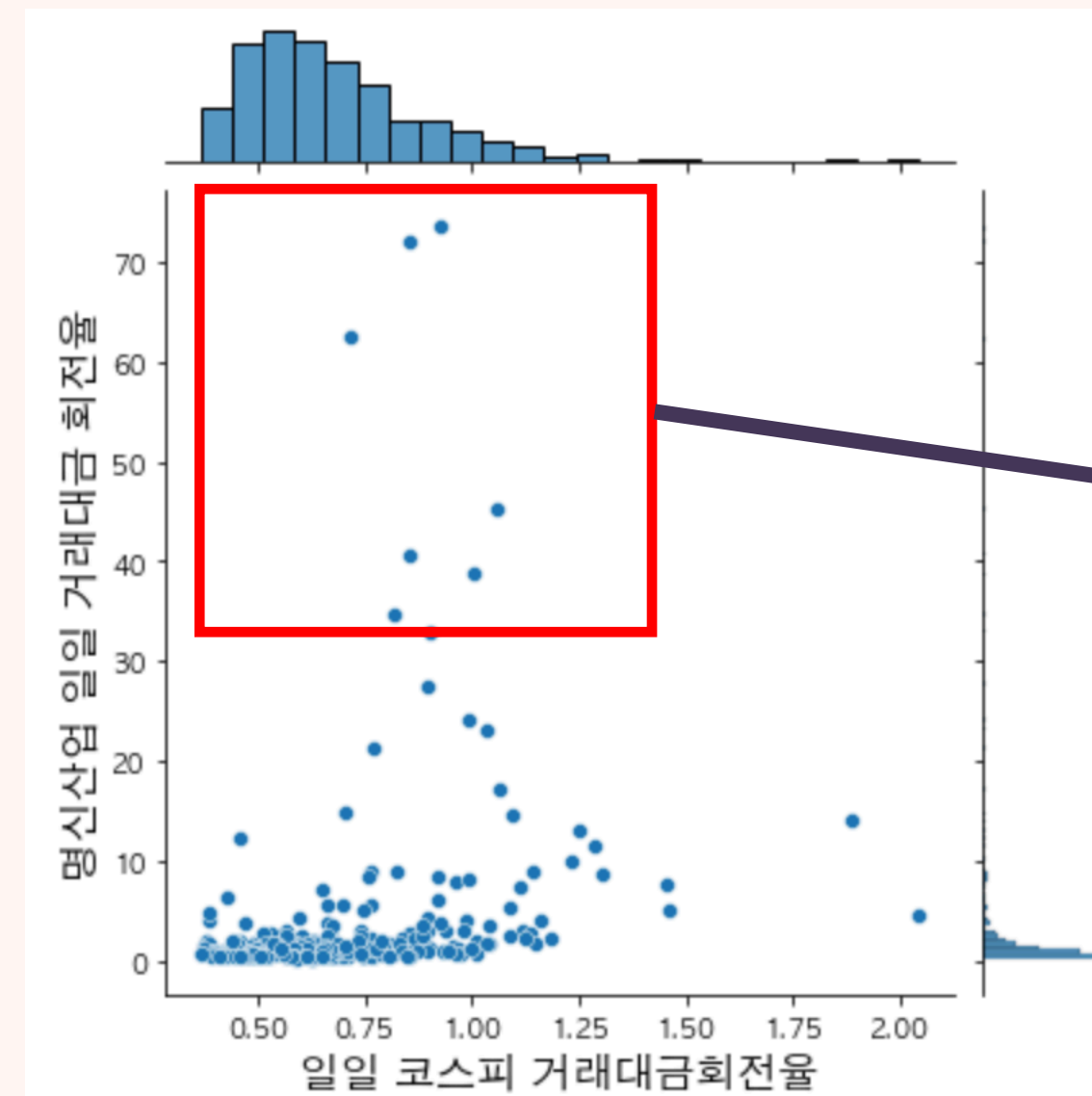


- 거래대금회전율과 거래량회전율의 분포가 정규분포가 아니라 피어슨 상관계수를 구하기 위한 정의를 충족하지 않았다고 생각합니다.
- 거래대금과 거래량은 항상 양수인 값을 가집니다.
- 그래서 둘사이 상관관계를 \log 를 활용해서 정규화를 시켜서 확인하는 것이 맞는것인지 아니면 스피어만 상관계수나 다른 상관계수를 사용하는게 맞는것인지 궁금합니다.

종목별 거래량 회전율과 거래대금 회전율



날짜
2020-12-08
2020-12-15
2020-12-16
2020-12-17
2020-12-18
2020-12-22
2020-12-30
2021-02-18

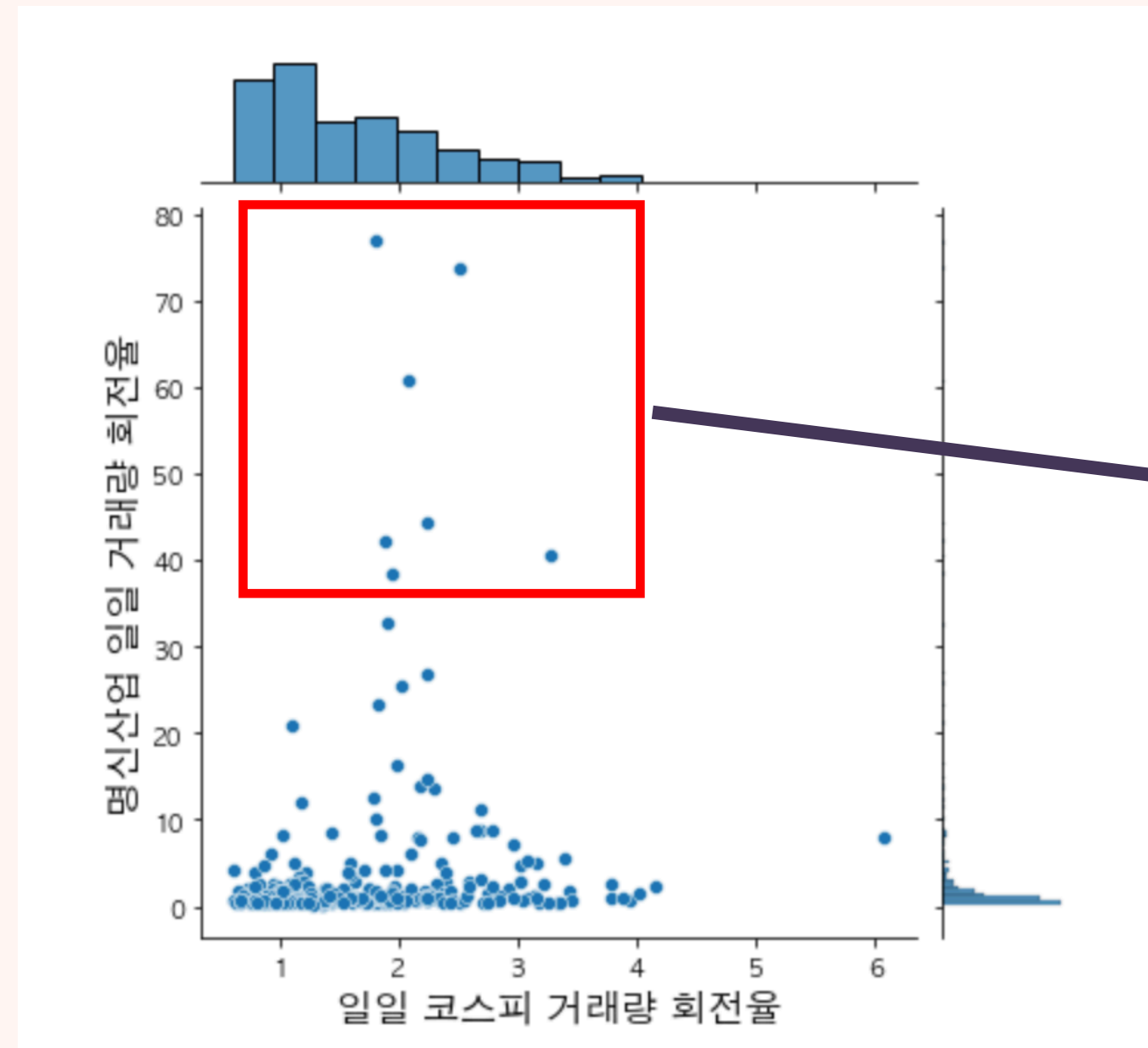


날짜
2020-12-08
2020-12-15
2020-12-16
2020-12-17
2020-12-18
2020-12-22
2020-12-30
2021-02-18

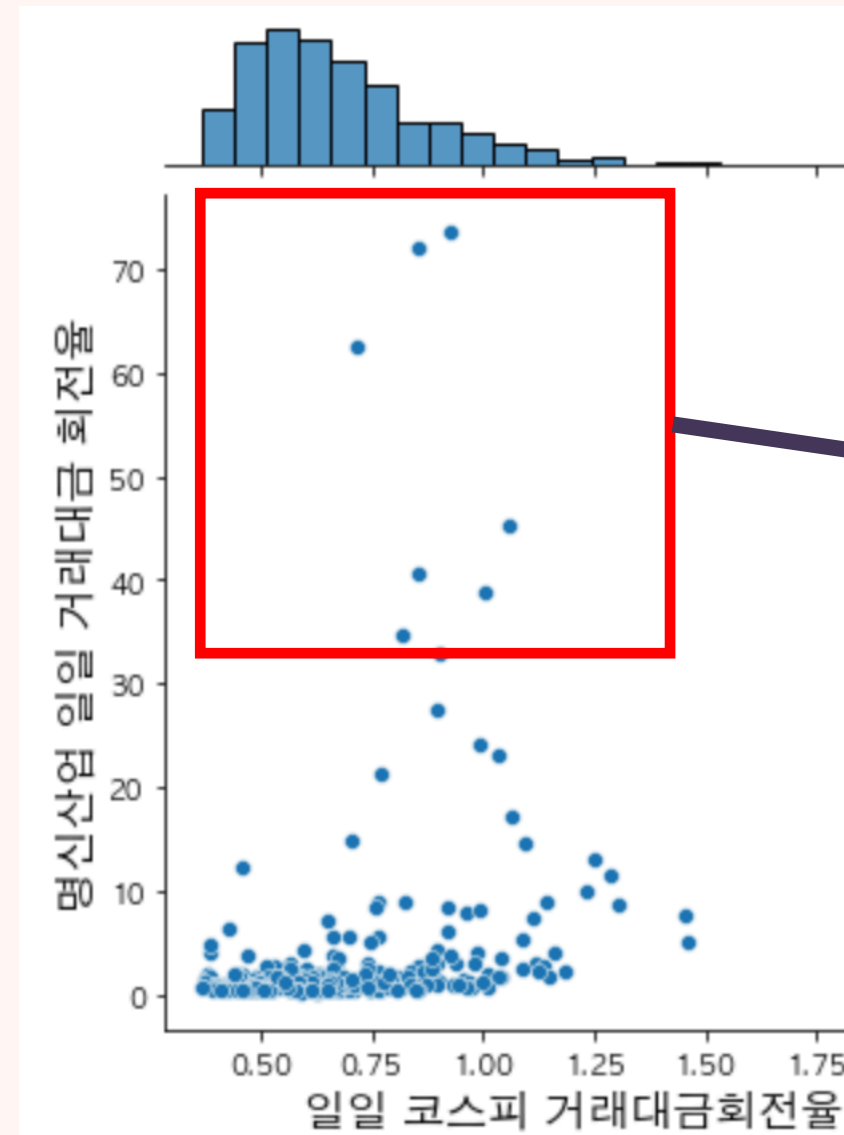
명신산업종목 거래대금회전율과 거래량회전율 상관계수 0.998995644326311

랜덤 샘플링 30개, 50번 반복했을때 거래량회전율과 거래대금회전율의 상관계수 평균의 평균 : 0.9992461379598788

종목별 거래량 회전율과 거



날짜
2020-12-08
2020-12-15
2020-12-16
2020-12-17
2020-12-18
2020-12-22
2020-12-30
2021-02-18



명신산업종목 거래대금회전율과 거래량회전율 상관계수 0.998995644326311

랜덤 샘플링 30개, 50번 반복했을때 거래량회전율과 거래대금회전율의 상관계수 평균의 평균 : 0.9992461379598788



'테슬라 효과' 명신산업, 너무 낮은 공모가 미스터리

명신산업 2년전 주당 2만원 평가..공모가 3분의 1발행주식 수 증가 고려하지 않은 '착시효과'실제론 공모가가 과...
[이데일리 박종오 기자] 공모가가 너무 싼 건가? 이달 초 증시에 입성한 명신산업(009900) 주가가 연일 꺾...
이데일리 | 2020.12.23 | 다음뉴스



'테슬라 테마주' 명신산업, 상장 후 '300%' 상승.. "단기과열 주의"

[서울=뉴시스] 김제이 기자 = 미국 전기차 업체 테슬라에 부품을 납품하는 명신산업의 주가가 상장 이후 300%가...
뉴시스 | 2020.12.22 | 다음뉴스

명신산업 '파상'..테슬라 효과 '엄지척'

[특징주 마감]

명신산업이 상장 첫 날 '파상'(거래 첫 날 공모가의 2배 가격에 시초가 형성, 이후 상한가)에 성공했다. 지난 11월 25일 하나기술 이후 처...
머니투데이 | 2020.12.07 | 다음뉴스

'테슬라 효과'..명신산업 상장 첫날 '파상' 서울경제 | 2020.12.07 | 다음뉴스

테슬라 납품에 가족회사 끼어든 명신산업..머스크 '노조 기피' 때문?

명신산업, 복잡한 테슬라 납품구조 '눈길'"테슬라 협력업체 심사 때 노조 있으면 불이익"오너 일가 가족회사 대신...
회사는 사업 구조가 왜 이리 복잡해요?" 이달 초 코스피(유가증권시장)에 상장해 주가가 고공 행진 중인 명신산업(009900) 주주들은 이렇게 묻는다. 명신산업은 세계 최대 전기차 생산 업체인 미국 테슬라에 차체 부품을 공급...
이데일리 | 2020.12.21 | 다음뉴스



12월 8일 공시진단 리뷰..명신산업

[한국경제TV 정연국 기자]12월7일 공시를 기반으로 12월8일 방송을 했습니다. 명신산업은 7일 코스피에 상장한...
한국경제TV | 2020.12.08 | 다음뉴스

명신산업 데뷔 첫날 '파상' 성공.. '파상상' 가나

상장 첫날 시초가 2배 형성 상한가 기록첫날 거래량 폭발 기록행진 미지수기관투자자 확약 물량 50% 밀돌아...
[이데일리 이지현 기자] 글로벌 전기차기업 테슬라의 부품공급사로 알려진 명신산업(009900)이 '파상'에 성공했...
다. 앞으로는 '파상상', '파상상상' 기록을 이어갈 수 있을지에 관심이 쏠리고 있다. 7일 마켓포인트에 따르면 명신...
이데일리 | 2020.12.07 | 다음뉴스

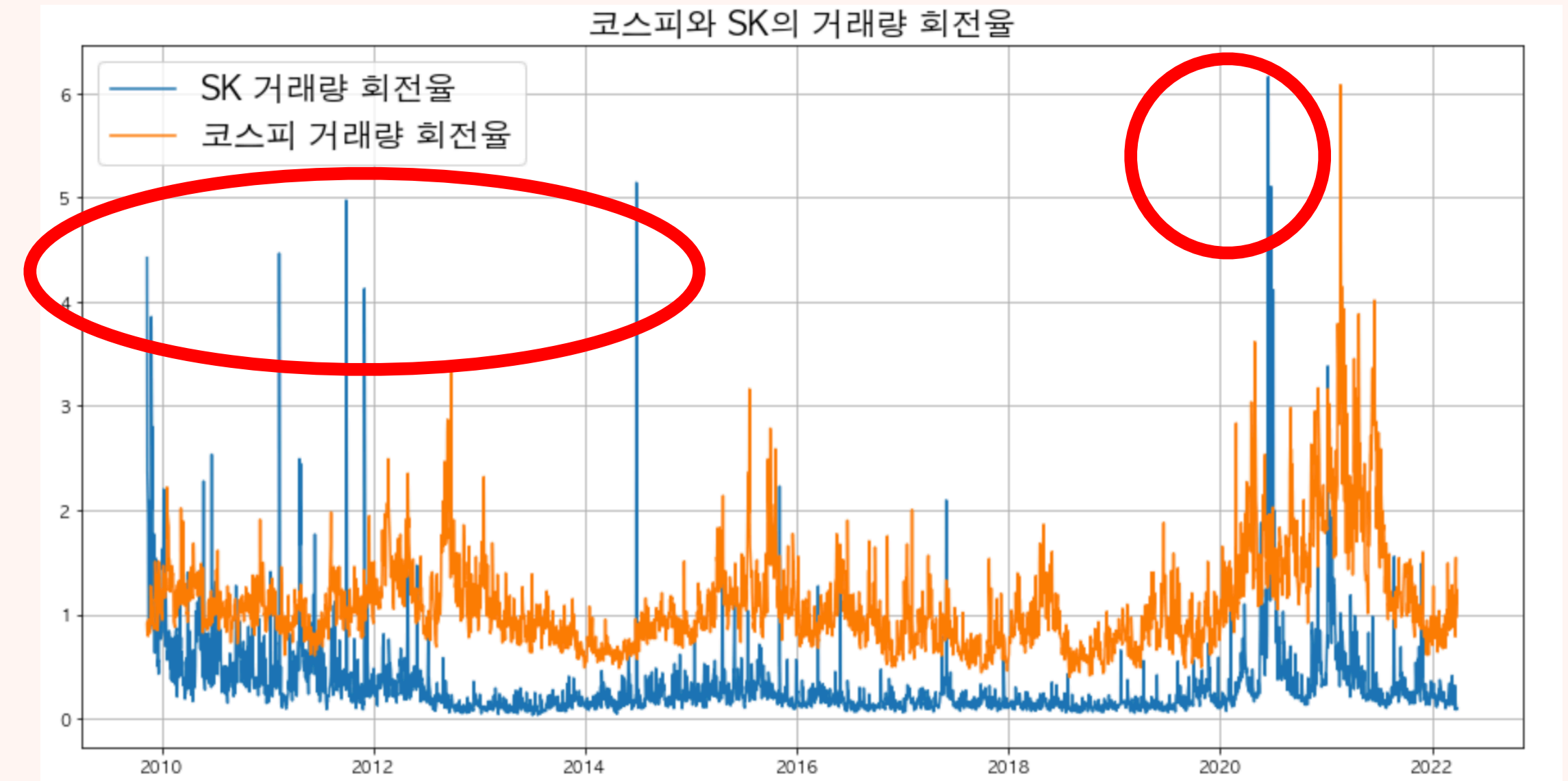
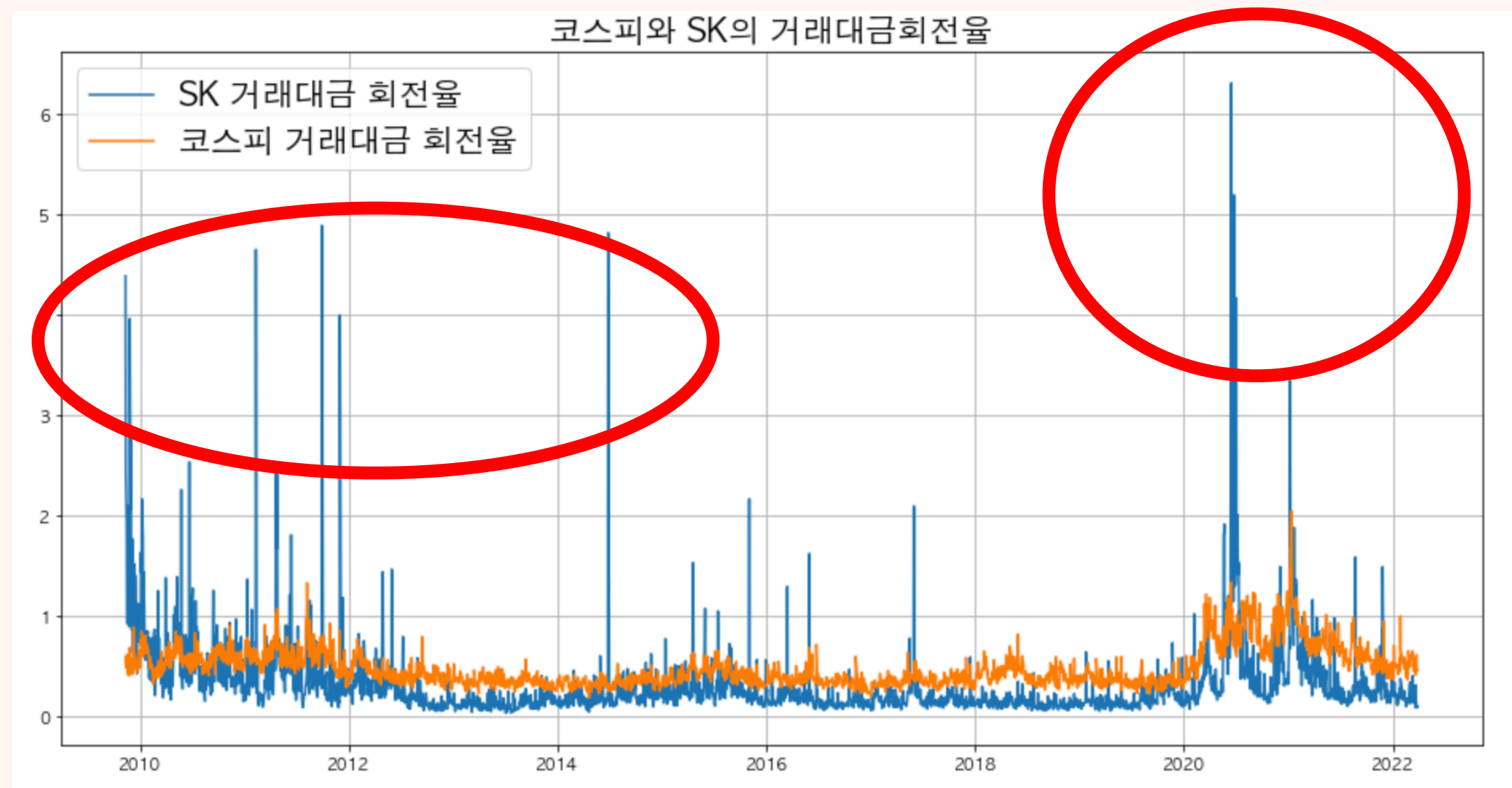
명신산업, 상장 첫날 '파상' 성공..계속 갈까? 이데일리 | 2020.12.07 | 다음뉴스

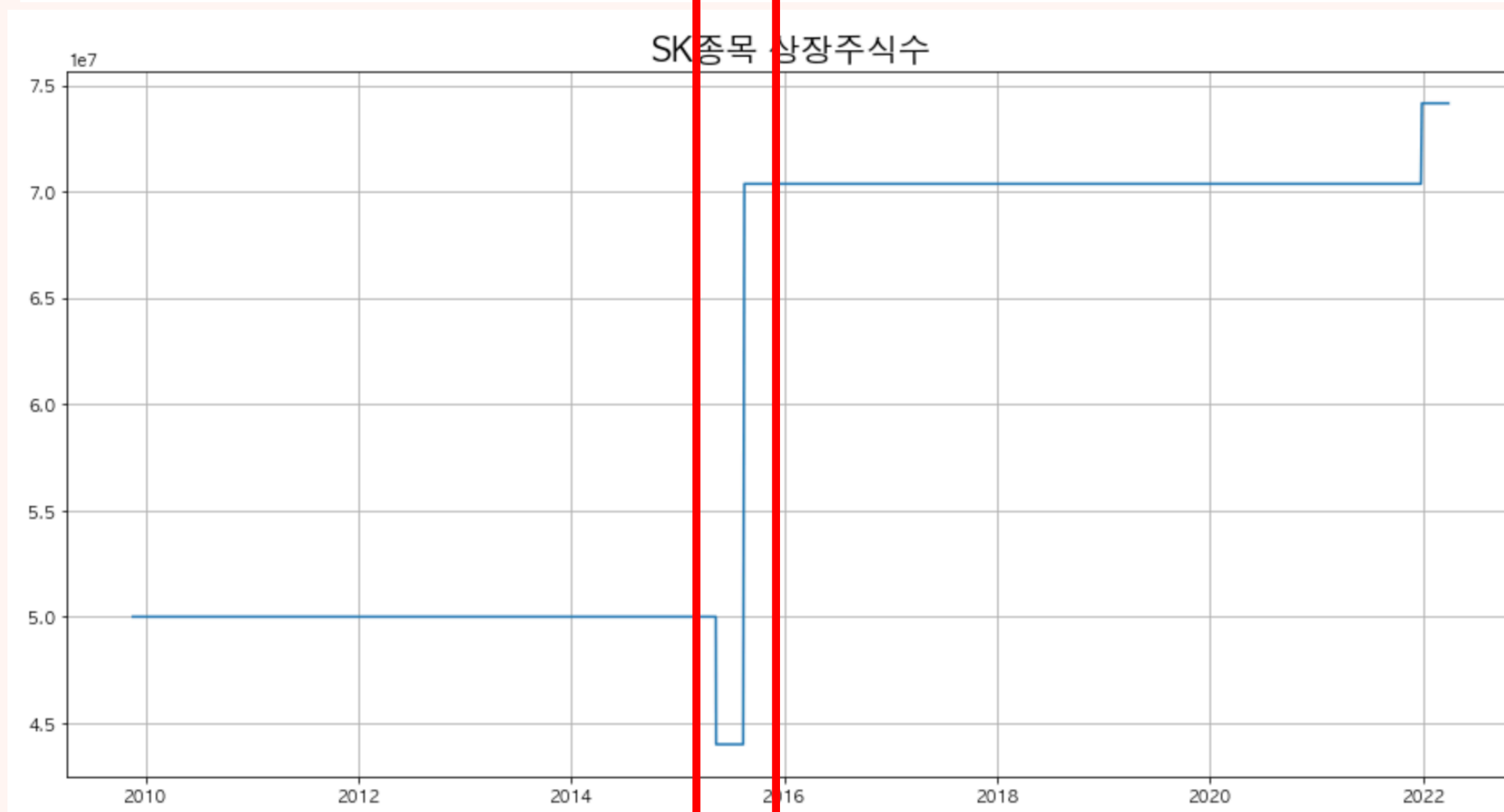
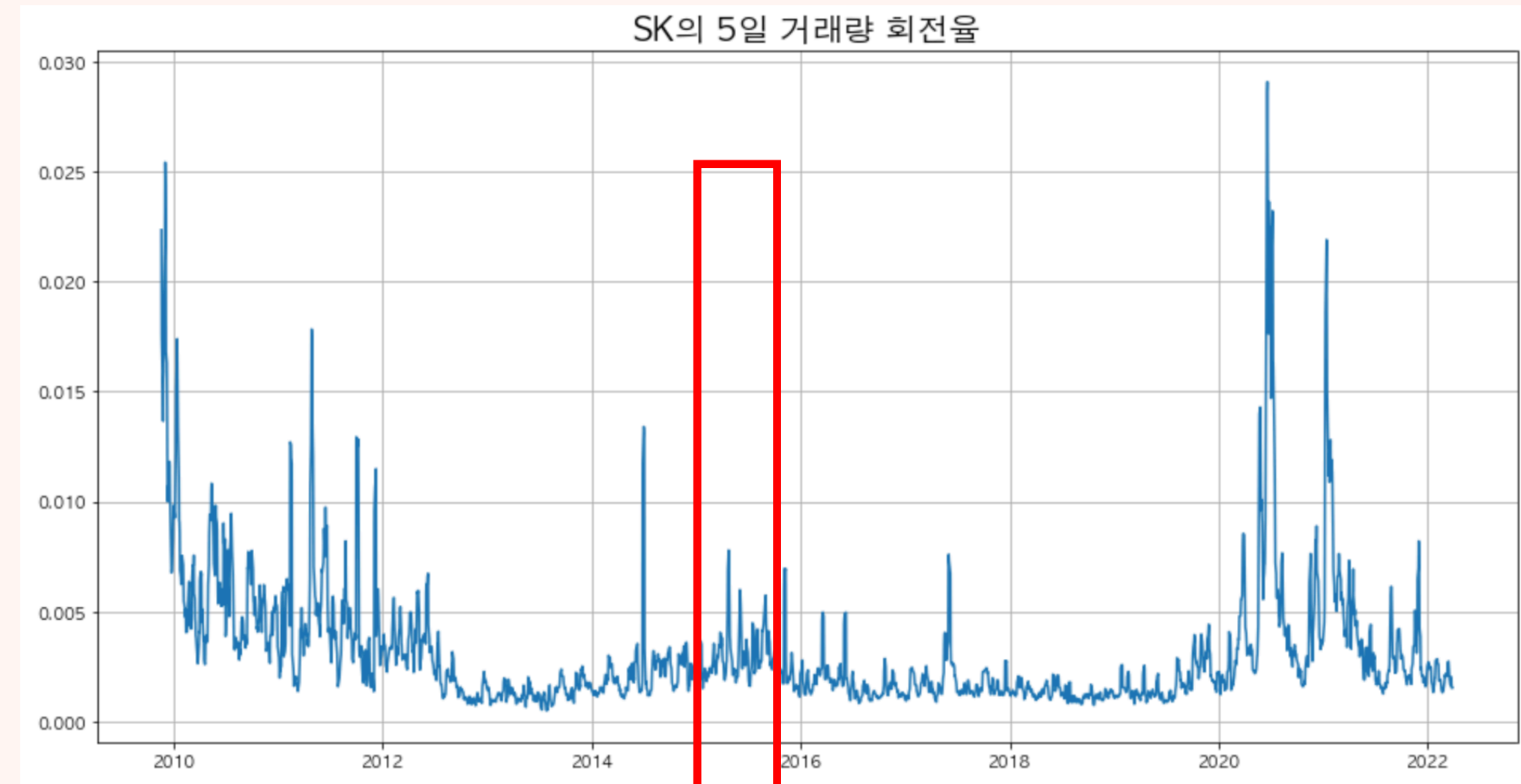
[특징주]명신산업, 상장 첫 날 '파상' 성공 이데일리 | 2020.12.07 | 다음뉴스

명신산업, 상장 첫날 '파상' 성공 Queen | 2020.12.07

구분	수량
관투자자	10,4
관투자자	3,
사주조합	1,
계	15,

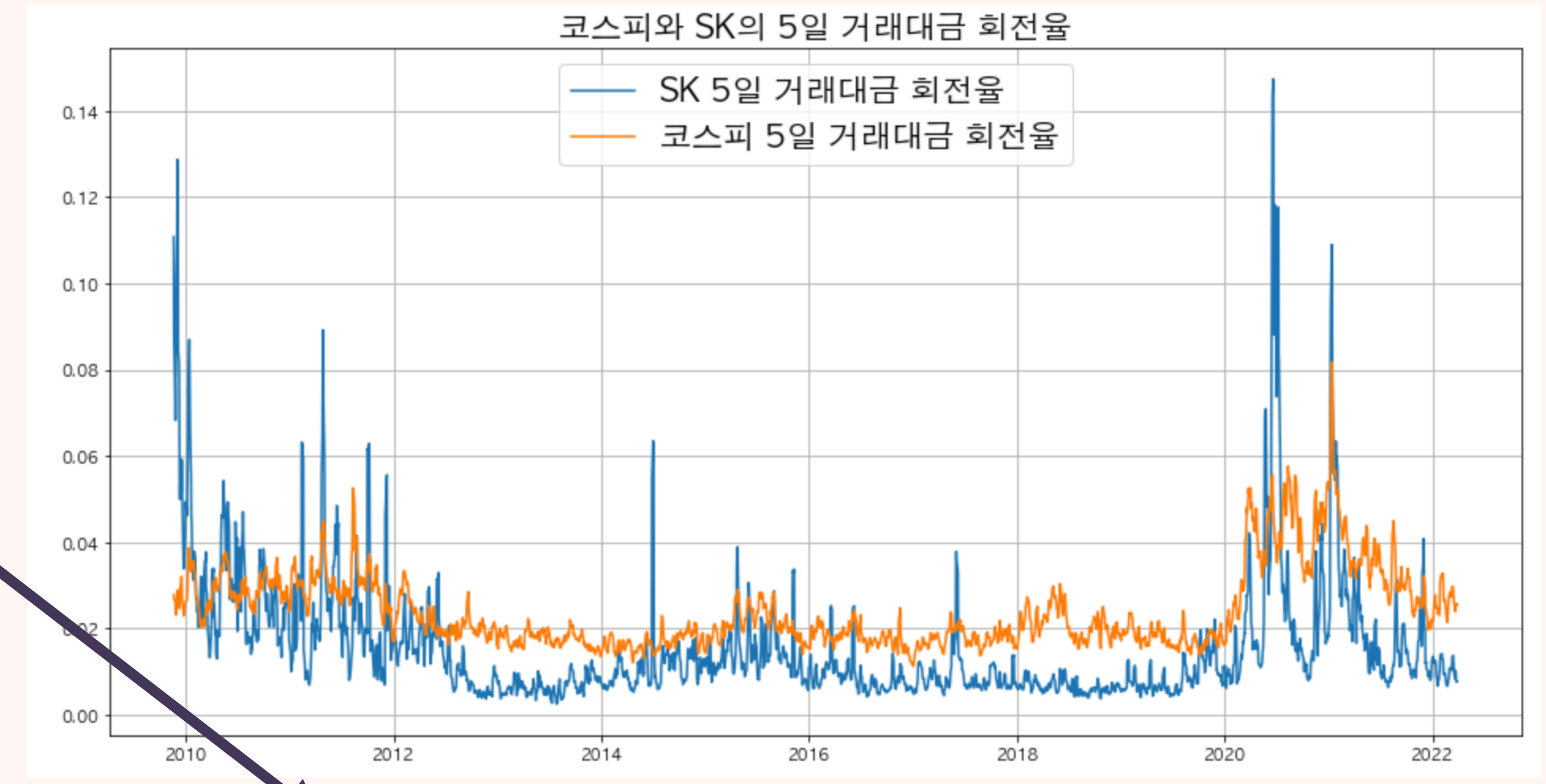
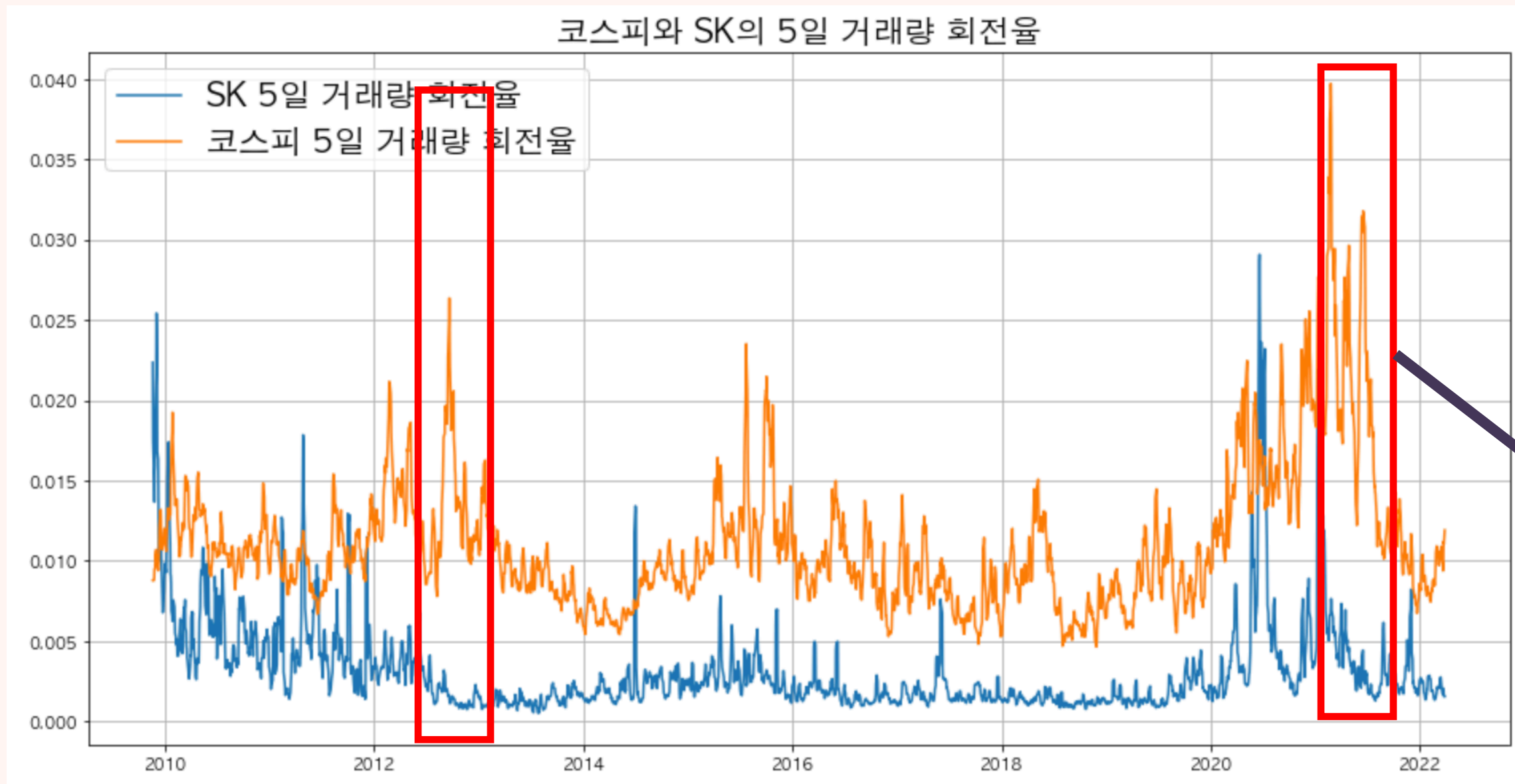
종목별 거래량 회전율과 거래대금 회전율





- 상장 주식수가 변하더라도 거래량 회전율 흐름에 큰 영향을 주지 않습니다.
- 코스피200 종목 상장주식수 변경에 따른 거래량 회전율의 영향에 대한 통계 조사가 필요해보입니다.

종목별 거래량 회전율과 거래대금 회전율



- 5일 거래량 회전율 : 5일 거래량 총합 / 5일 평균 상장주식수
- 5일 거래대금 회전율 : 5일 거래대금 총합 / 5일 평균 시가총액

- 코스피 거래량 회전율 대비 크게 낮은 회전율을 가질때도 과연 이상치 라고 판단해야하는지 아닌지 고려가 필요합니다.