기관수급분석 정리

- 주제: 5일 동안 연속으로 기관이 순 매수한 종목의 이후 10일간 수익률 분석
- 대상: 코스피, 코스닥 전 종목
- 방법
 - 1. 기관 순매수 값이 0보다 큰 경우가 5일 연속으로 나타남
 - 2. 6일 째 시가(Open)로 매수
 - 3. 6일 째 종가(Close)로 매도
 - 4. 6일 째 수익률 = (6일 째 종가 6일 째 시가) / 6일 째 시가
 - 5. 3, 4번의 6일 째 종가 → 7일 째 종가로 변경 후 3, 4번 실행
 - 6. 6일부터 15일까지 바꿔가면서 실행
 - 7. 모든 일자에 대해서 위 작업 진행 후 정리
- 중간 결과 테이블 스키마: 종목 단위로 테이블 생성

매수일(6일날짜)	6일째 수익률	7일째 수익률	8일째 수익률	9일째 수익률	10일째 수익률	11일째 수익률	12일째 수익률	13일째 수익률	14일째 수익률	15일째 수익률
2020-04-14	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

• 최종 결과 테이블 스키마

종목명	종목코드	항목	6일째 수익률	7일째 수익률	8일째 수익률	9일째 수익률	10일째 수익률	11일째 수익률	12일째 수익률	13일째 수익률	14일째 수익률	15일째 수익률
동화약퓸	000020	Max	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
동화약퓸	000020	Min										
동화약퓸	000020	Mean										
동화약퓸	000020	Median										
동화약퓸	000020	1Q										
동화약퓸	000020	3Q										
동화약퓸	000020	수익확률										
•••	•••	•••										

^{*} 수익확률: 전체 Case 중 해당 일째에 수익이 나는 비율

기관수급분석 예시

종목: KOSPI 동화약품(000020) * 아래 테이블은 가격 테이블 & 수급 테이블 조인해야 합니다.

	-1-4-		NI-tDA		0	L I de auto	1	Class	A -1: Cl	
	date	•••	NetBuyAmount_Inst		Open	High	Low	Close	Adj_Close	
첫	번째 Case ◆		13106	1	6930	7220	6930	7190	7190	_
ـــا	2020 07 01		22783	2	7300	7450	6930	7430	7430	 5일 연속 기관 순매수
	2020-04-08		16755	3	7430	7700	7310	7650	7650	
	2020-04-09		30123	4	7750	7750	7530	7650	7650	첫 번째 Case
	2020-04-10		17240	5	7700	7860	7310	7730	7730	그 첫 현제 Case
	2020-04-13		9743	6	7730	7750	7490	7490	7490	<mark>│← 6일째 시가로 매수 ← 6일째 종가로 매도</mark> -3.10
	2020-04-14		9800	7	7590	7590	7420	7500	7500	7일째 종가로 매도 -2.98
	2020-04-16		-541	8	7420	7630	7330	7630	7630	(8일째 종가로 매도 -1.29
	2020-04-17		35051	9	7650	7730	7540	7720	7720	9일째 종가로 매도 -0.13
	2020-04-20		-6595	10	8700	8700	7850	8050	8050	10일째 종가로 매도 4.14
	2020-04-21		-55831	11	8240	10450	8220	10450	10450	11일째 종가로 매도 35.19
	2020-04-22		-83537	12	11950	12450	10650	10750	10750	12일째 종가로 매도 39.07
	2020-04-23		-22383	13	10800	11500	10600	10900	10900	13일째 종가로 매도 41.01
	2020-04-24		281	14	10800	10800	10150	10150	10150	14일째 종가로 매도 31.31
	2020-04-27		-226	15	10100	10550	10100	10450	10450	15일째 종가로 매도 35.19

중간 테이블 결과 예시

	매수일(6일날짜)	6일째 수익률	7일째 수익률	8일째 수익률	9일째 수익률	10일째 수익률	11일째 수익률	12일째 수익률	13일째 수익률	14일째 수익률	15일째 수익률
→	2020-04-13	-3.1	-2.98	-1.29	-0.13	4.14	35.19	39.07	41.01	31.31	35.19
	2020-04-14										
	2020-04-16										

기관수급분석 예시

종목: KOSPI 동화약품(000020)

	date		NetBuyAmount_Inst	t	Open	High	Low	Close	Adj_Close	
大·	번째 Case ◆		13106	1	6930	7220	6930	7190	7190	
	2020 07 07		22783	2	7300	7450	6930	7430	7430	
	2020-04-08		16755	3	7430	7700	7310	7650	7650	
Ł	두 번째 Case	ţ		4	7750	7750	7530	7650	7650	첫 번째 Case
Ī	2020-04-10		17240	5	7700	7860	7310	7730	7730	<u> </u>
	2020-04-13		9743	5	7730	7750	7490	7490	7490]🛑 6일째 시가로 매수 🛑 6일째 종가로 매도 -3.10%
_	2020_0/_1/	Γ	9800	7	7590	7590	7420	7500	7500	← 7일째 종가로 매도 -2.98%
┨	세 번째 Case	┛	-541	8	7420	7630	7330	7630	7630	수 8일째 종가로 매도 -1.29%
	2020-04-17		35051	9	7650	7730	7540	7720	7720	수 9일째 종가로 매도 -0.13%
	2020-04-20		-6595	10	8700	8700	7850	8050	8050	(- 10일째 종가로 매도 4.14%
	2020-04-21		-55831	11	8240	10450	8220	10450	10450	(11일째 종가로 매도 35.19%
	2020-04-22		-83537	12	11950	12450	10650	10750	10750	12일째 종가로 매도 39.07%
	2020-04-23		-22383	13	10800	11500	10600	10900	10900	13일째 종가로 매도 41.01%
	2020-04-24		281	14	10800	10800	10150	10150	10150	14일째 종가로 매도 31.31%
	2020-04-27		-226	15	10100	10550	10100	10450	10450	- 15일째 종가로 매도 35.19%

중간 테이블 결과 예시

	매수일(6일날짜)	6일째 수익률	7일째 수익률	8일째 수익률	9일째 수익률	10일째 수익률	11일째 수익률	12일째 수익률	13일째 수익률	14일째 수익률	15일째 수익률
•	2020-04-13	-3.1	-2.98	-1.29	-0.13	4.14	35.19	39.07	41.01	31.31	35.19
•	2020-04-14										
•	2020-04-16		_								