

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 바뀌가면서 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
동화약품	000020	Max	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
동화약품	000020	Min										
동화약품	000020	Mean										
동화약품	000020	Median										
동화약품	000020	1Q										
동화약품	000020	3Q										
동화약품	000020	수익확률										
...										

* 수익확률: 전체 Case 중 해당 일째에 수익이 나는 비율

종목: KOSPI 동화약품(000020)

첫 번째 Case

5일 연속 기관 순매수

첫 번째 Case

6일째 시가로 매수

6일째 증가로 매도	-3.10%
7일째 증가로 매도	-2.98%
8일째 증가로 매도	-1.29%
9일째 증가로 매도	-0.13%
10일째 증가로 매도	4.14%
11일째 증가로 매도	35.19%
12일째 증가로 매도	39.07%
13일째 증가로 매도	41.01%
14일째 증가로 매도	31.31%
15일째 증가로 매도	35.19%

[illegible]

종목: KOSPI 동화약품(000020)

첫 번째 Case

6일째 증가로 매도	-3.10%
7일째 증가로 매도	-2.98%
8일째 증가로 매도	-1.29%
9일째 증가로 매도	-0.13%
10일째 증가로 매도	4.14%
11일째 증가로 매도	35.19%
12일째 증가로 매도	39.07%
13일째 증가로 매도	41.01%
14일째 증가로 매도	31.31%
15일째 증가로 매도	35.19%

[illegible]