

PROJECT C+E

너에게 모든
것을 바칩니다.
최마정애.

FINAL PROJECT



7차 회의 - 업무 브리핑



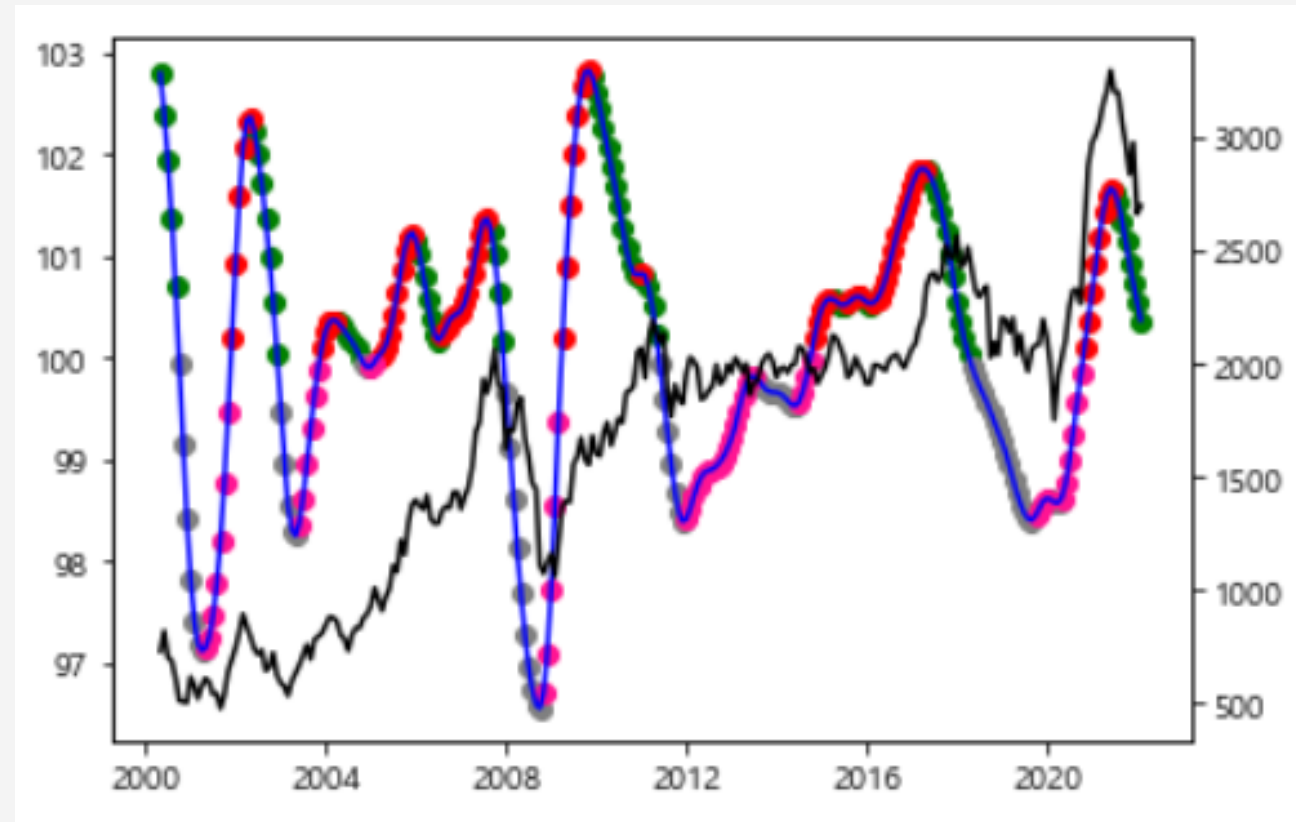
업무 브리핑



기타 논의

2022 04/28 비주식팀 업무 브리핑

업무 내용	뉴스 데이터 크롤링 (빅카인즈) https://www.youtube.com/watch?v=szv7MCSAxaQ 데이터는 확보, but 크롤링은 잘 안되는 듯 CLI 모멘텀 스코어를 이용하여 시그널 포착, 경기 4국면 시그널도 만듦
결과	모멘텀 스코어 : 성장/둔화/회복/위축 4개의 국면 성장/회복 국면에 코스피 수익률이 높음 모멘텀 스코어에 따라 투자를 할 시 수익률이 높음 2가지 시그널 모두 유효
미비점 및 피드백 사항	미비점 없음. 너무 잘됨.
내일 업무 내용	채권 투자 전략을 짜고 수익률을 기간별로 구해서 디테일하게 시그널을 포착하면 될 듯



<경기 4국면 시그널>



<cli 모멘텀 스코어 시그널>

CLI 모멘텀 스코어를 이용해서 경기 4국면 시그널을 포착했고
 CLI 모멘텀 스코어 만으로도 유의미한 수익률을 얻을 수 있음
 다만, OECD CLI 발표일 기준으로 그래프를 세부 조정할 필요가 있음 <한 달 정도 간격>

2022 04/28 주식팀 업무 브리핑

업무 내용	업무내용 강호홍정민형-데이터 전처리및 가공 , 목표했던 데이터 틀에 맞게 통일. 승희-재무재표기준총정리및 표기
결과	오늘안에 업무 완료 가능.
미비점 및 피드백 사항	데이터가공완료후 내일 함수설정할때 맞지않는 데이터나 널값처리에대해 논의해봐야함. 가공을 또다시 해야할수도 있음
내일 업무 내용	함수구현및, 데이터가공(예정)

BEFORE

코스피재무제표.head()

	date	symbol	entity_name	type_id	report_id	account_id	name_ko	value
0	1996-12-31	001880	DL건설	K	11	1100	현금및현금등가물	2.002153e+09
1	1996-12-31	001880	DL건설	K	11	1130	예금	2.002153e+09
2	1996-12-31	001880	DL건설	K	11	1131	당좌예금	7.622000e+06
3	1996-12-31	001880	DL건설	K	11	1134	기타예금	1.994531e+09
4	1996-12-31	001880	DL건설	K	11	1140	단기투자증권	5.510902e+09

코스피추가.head()

	DATE	Yymm	FS_YEAR	FS_MONTH	FS_QTR	MAIN_TERM	per	현금배당수익률	pbr	esp증가율	psr	pcr	실적보고발표일	code
0	2003	200312	2003	12	Annual	개별/별도	NaN	NaN	0.0	17.380	NaN	NaN	20040401.0	A095570
1	2004	200412	2004	12	Annual	개별/별도	NaN	NaN	0.0	46.518	NaN	NaN	20050331.0	A095570
2	2005	200512	2005	12	Annual	개별/별도	NaN	NaN	0.0	33.149	NaN	NaN	20060410.0	A095570
3	2006	200612	2006	12	Annual	개별/별도	NaN	NaN	0.0	33.016	NaN	NaN	20070327.0	A095570
4	2007	200712	2007	12	Annual	개별/별도	NaN	NaN	0.0	16.011	NaN	NaN	20080331.0	A095570

AFTER

수정

	date	symbol	entity_name	type_id	report_id	account_id	name_ko	value
0	200312	095570	AJ네트웍스	K	fn	11111	per	NaN
1	200412	095570	AJ네트웍스	K	fn	11111	per	NaN
2	200512	095570	AJ네트웍스	K	fn	11111	per	NaN
3	200612	095570	AJ네트웍스	K	fn	11111	per	NaN
4	200712	095570	AJ네트웍스	K	fn	11111	per	NaN
...
14037	201712	003280	흥아해운	K	fn	77777	실적보고발표일	20180315.0
14038	201812	003280	흥아해운	K	fn	77777	실적보고발표일	20190321.0
14039	201912	003280	흥아해운	K	fn	77777	실적보고발표일	20200409.0
14040	202012	003280	흥아해운	K	fn	77777	실적보고발표일	20210318.0
14041	202112	003280	흥아해운	K	fn	77777	실적보고발표일	20220321.0

98294 rows × 8 columns



FINAL PROJECT
