



PROJECT C+E

너에게 모든  
것을 바칩니다.  
최마정애.

# FINAL PROJECT



9차 회의 - 업무 브리핑



**업무 브리핑**



**기타 논의**

2022 05/02 비주식팀 업무 브리핑

업무 내용	채권 시가 데이터 + 발행일, 만기일 데이터 병합 완료 (총 35만건) 그러나 추가적인 정보가 필요 (신용등급 및 채권 종류) 채권 옵션, 할인율, 신용등급, 이자계산주기, 이자지급방식 등 관련 데이터 셀레니움으로 크롤링중... + 투자전략 및 응용을 위해서 채권 내용 따로 공부하는 중
결과	총 9000개 종목코드의 데이터를 수집하는 중 이며, 중간확인 결과 크롤링이 오류없이 작동되고 있음을 확인
미비점 및 피드백 사항	데이터 수집 시간이 오래걸리고 고도화된 개념 숙지가 필요하기 때문에 데이터 수집시간을 활용하여 개인 공부를 해야 할 듯
내일 업무 내용	채권 투자전략 구현

2022 05/02 주식팀 업무 브리핑

업무 내용	아침에 연결재무제표와 개별재무제표 관련하여 논의 결론 - 코스피부터 일단 완료한후 생각하기로 함 오늘 업무할당 1. 데이터 가공 및 계산 승희,홍정,민형 2. 함수 생성 강호
결과	함수 생성중 오늘 까지 종목선정 함수는 완료가능할듯 데이터 가공 일부 완료.
미비점 및 피드백 사항	없음 조원들의 배움의 의지가 강해서 좋습니다.
내일 업무 내용	수익률 함수 생성및 데이터 가공처리 완료 그다음 코스닥 데이터 관련 논의및 결정

## 유동성함수 ¶

- 유동비율, 당좌비율, 유보율
- 유동비율  $\geq 200\%$  "200%미만 0, 200%이상 1"
- 당좌비율  $\geq 100\%$  "100%미만 0, 100%이상 1"
- 유보율  $> 200\%$  "200%이하 0, 200%초과 1"

**def** 유동성종목선정함수(연도):

당해연도 = 코스피재무제표[코스피재무제표['날짜'].str.contains(연도)]  
 당해연도['값'] = 당해연도['값'].astype(float)

유동비율 = 당해연도[(당해연도['재무요소']=='유동비율') & (당해연도['값'] $\geq 2$ )].sort\_values('값',ascending=False)  
 유동비율리스트 = 유동비율.drop\_duplicates('종목명',keep='first')['종목명'].tolist()  
 당좌비율 = 당해연도[(당해연도['재무요소']=='당좌비율') & (당해연도['값'] $\geq 1$ )].sort\_values('값',ascending=False)  
 당좌비율리스트 = 당좌비율.drop\_duplicates('종목명',keep='first')['종목명'].tolist()  
 자본유보율 = 당해연도[(당해연도['재무요소']=='자본유보율') & (당해연도['값'] $> 2$ )].sort\_values('값',ascending=False)  
 자본유보율리스트 = 자본유보율.drop\_duplicates('종목명',keep='first')['종목명'].tolist()

유동비율리스트 = pd.DataFrame(index = 유동비율리스트, columns = ['유동비율리스트'])  
 유동비율리스트['유동비율리스트'] = 1  
 당좌비율리스트 = pd.DataFrame(index = 당좌비율리스트, columns = ['당좌비율리스트'])  
 당좌비율리스트['당좌비율리스트'] = 1  
 자본유보율리스트 = pd.DataFrame(index = 자본유보율리스트, columns = ['자본유보율리스트'])  
 자본유보율리스트['자본유보율리스트'] = 1

항목구하기 = pd.merge(유동비율리스트, 당좌비율리스트, left\_index=True, right\_index=True, how='left')  
 항목구하기 = pd.merge(항목구하기, 자본유보율리스트, left\_index=True, right\_index=True, how='left')  
 항목구하기 = 항목구하기.fillna(0)

항목구하기['총점수'] = 항목구하기['유동비율리스트'] + 항목구하기['당좌비율리스트'] + 항목구하기['자본유보율리스트']  
 항목구하기 = 항목구하기.sort\_values('총점수',ascending=False)  
 종목선정완료 = 항목구하기[항목구하기['총점수'] $\geq 3.0$ ].index.tolist()

**return** 종목선정완료

레버리지종목선정함수('2007')

```
C:\Users\713\AppData\Local\Temp\ipykernel_1972\1972.py:1:
A value is trying to be set on a copy of a slice from a DataFrame.
Try using .loc[row_indexer,col_indexer] = value instead.
See the caveats in the documentation: https://pandas.pydata.org/pandas-docs/stable/10min/05min.html#copy-on-write
a-copy
당해연도['값'] = 당해연도['값'].astype(float)

['현대미포조선',
 'KT&G',
 '현대그린푸드',
 '태원물산',
 'NICE',
 '아모레G',
 '아모레퍼시픽',
 '롯데칠성',
 '일성신약',
 '대교']
```

	유동비율리스트	당좌비율리스트	자본유보율리스트	총점수
에이프로젠제약	1	1.0	1.0	3.0
한국카본	1	1.0	1.0	3.0
동아타이어	1	1.0	1.0	3.0
신라교역	1	1.0	1.0	3.0
삼호개발	1	1.0	1.0	3.0
...	...	...	...	...
프레스티지바이오파마	1	1.0	0.0	2.0
종근당바이오	1	0.0	1.0	2.0
진도	1	0.0	1.0	2.0
SK디앤디	1	0.0	1.0	2.0
남해화학	1	0.0	1.0	2.0

# 주식팀 업무 브리핑



성장성	EPS성장율=주당순이익증가율	o		EPS성장률>10%	10%이하 0 11%이상 1	#N/A	기본주당순이익은 제공 (주당이익증가율)	전년비교 파이썬으로
수익성	ROE = 자기자본순이익율	o		ROE>10%, 상위30%	10%이하 0 11%이상 1	2070	자기자본순이익율	워렌버핏(ROE가 10%)
수익성	ROA = 총자산이익율	x	당기순이익/총자산*100	ROA>10%	10%미만 0 11%이상 1	5000	자산총계	총당기순이익 (완료하
수익성	ROS = 매출액순이익율	o	당기순이익/매출액*100	순이익증가율>5%	5%이하 0 6%이상 1	2110	매출액순이익율	
수익성	ROIC = 투자자본이익률	o	세후순영업이익(NOPAT)/ 영업투자자본(IC)'	ROIC>15% (찰리티안)	15%이하 0 16%이상 1	2050	경영자본영업이익율	<a href="http://www.itooza.com/0000000163">http://www.itooza.com/0000000163</a> <a href="https://blog.naver.com/itooza">https://blog.naver.com/itooza</a>
시장가치	EPS=주당순이익	x	당기순이익/발행주식수	EPS>10%	10%이하 0 11%이상 1	9009	기본주당순이익	
시장가치	PSR=주가매출비율	x	시가총액/매출액	PSR>=4%	3미만 0 4이상 1	#N/A		
시장가치	BPS=주당순자산가치	x	기업순자산(자산-부채)/ 발행주식수	PCR>8%	8미만 0 9이상 1	#N/A		
시장가치	PER=주가수익비율	x	시가총액/당기순이익	PER>10%	10%이하 0 11%이상 1	#N/A		
시장가치	PCR=영업현금흐름대비주가	x	시가총액/영업현금흐름	0<PCR<10	0이하 0 11이상0 1~9 1	#N/A		
시장가치	PBR=주가순자산가치	x	현재주가/BPS	PBR>0	1미만 0 1이상 1	#N/A		
시장가치	EBITDA	o	(감가상각비등 영업이익+비현금성비용+ 제세금)	EBITDA>4	4이하 0 4초과 1	9700	EBITDA	



# FINAL PROJECT

---