<Term Paper Outline>

글로벌 이벤트에 따른 경제 구조의 변화 여부 및 국가 간 주가 동조화 현상 분석

– 산업군별 비교를 중심으로

20120559 김민수

20170547 문예진

1. 서론

글로벌 이벤트는 경제 구조의 대대적인 변화를 초래함으로써 주식 시장의 움직임을 주도하는 산업군의 구성에 중대한 영향을 끼친다. 따라서 본 Term Paper에서는 과거 글로벌 이벤트의 사례를 분석하고 COVID-19 대유행에 따른 종합주가지수 주도 산업군의 변화 여부를 확인한다. 또한 산업군 별 주가지수의 움직임을 분석함으로써 글로벌 이벤트가 해외 주요 국가들의 주가와 국내 주가들 간의 동조화 현상을 확대/축소시키는 데에 어떠한 영향을 미치는지에 대해 확인해볼 것이다. 이로써 COVID-19 대유행 이후 국내 주가의 움직임을 예측하는 자료로 활용할 수 있을 것으로 기대하고 있다.

1. 본론: 데이터 및 분석 방법론 설명
2. 데이터 설명
3. 출처: 국내외 주가에 관한 데이터는 Yahoo finance에서 제공하는 데이터를 활용하였으며, 글로벌 이벤트 전후 1년을 기준으로 삼아 변화 여부를 분석하였다.
4. 국가별 종합주가지수 : 한국, 미국, 중국, 일본의 종합주가지수는 각각 KOSPI지수, S&P 500 지수, 상해종합지수, NIKKEI 지수를 이용하였다.
5. 산업군별 주가지수 : 각 국가의 산업군 별로 소속된 기업의 시가총액을 기준으로 하여 상위 5개의 기업의 주가 평균을 지수화하였으며, 산업군 분류 기준은 Investing.com에서 설정된 12가지 Sector 분류 기준을 이용하였다.
6. 분석방법론
7. PCA Analysis을 이용하여 주가지수 주도 산업군 변화 여부 분석
8. 과거 글로벌 이벤트 전후의 종합주가지수 주도 산업군의 변화 여부 확인 – 종합주가지수 최저점 전, 후로 기간 설정
9. COVID-19 대유행 전후 종합주가지수 주도 산업군의 변화 여부 확인.
10. Random Forest 모델을 활용한 산업군별 주가 동조화 현상 존재 여부 확인
11. 과거 글로벌 이벤트 전후의 산업군별 국가간 주가 동조화 현상의 변화 여부 확인.
12. COVID-19 전후의 산업군별 국가 간 주가 동조화 현상의 변화 여부 확인.
13. 결론 : 분석 결과를 토대로 서술할 예정.