

# 가설 설정

유튜브 및 여러 블로그에서 얻은 정보를 바탕으로 몇 가지 가설을 세웠습니다. 여기서 가설이란 이런 경우 주가가 상승한다하는 가정입니다. 아래는 제가 찾은 정보입니다. 독자분들은 더 좋은 가설을 세우실 수 있을 것이라고 생각합니다. 가설의 깊이가 예측 모델의 성능을 좌우합니다.

- 변동성이 크고 거래량이 몰린 종목이 주가가 상승한다.
- 5일 이동 평균선이 오늘 증가보다 위에 위치해 있다.
- 위 꼬리가 긴 양봉이 자주 발생한다.
- 거래량이 종종 크게 터지며 매집의 흔적을 보인다.
- 주가지수보다 더 좋은 수익률을 자주 보여준다.
- 동종업계의 평균 수익률보다 좋은 수익률을 보여준다.
- 개인투자자보다는 투신/사모펀드 등이 매수를 많이 한다.

마지막 가설(투자자)의 경우는 증권사 API 등을 활용하여 데이터를 추출을 해야하므로 별도의 공부도 필요합니다. 모델의 입력변수로 활용하지는 않겠습니다.

아래는 몇 가지 가설에 대한 차트 예시입니다. 우리가 데이터 분석으로 증명하고 싶은 것은 “각 패턴이 통계적으로 유의미하게 자주 발생하는가?” 입니다.

- **5일 이동 평균선이 오늘 증가보다 위에 위치해 있다.**

아래 3월 15일 노란색 부분을 매수 시점이라고 가정을 하면 5일 이동 평균선(녹색선)보다 증가가 아래에 위치해 있다가, 향후 이동평균선을 따라가는 모양을 보여주고 있습니다.



- **거래량이 종종 크게 터지며 매집의 흔적을 보인다.**

아래 차트에서 6월 10일 매수시점이라고 하면 급 상승 전에 거래량이 크게 자주 발생한 것을 확인할 수 있습니다.

셀리드 시 138,000 고 140,200 저 132,500 중 133,000 ▼4,400 -3.20% 거 677,683

이동평균 5 20 60 120



- 위 꼬리가 긴 양봉이 자주 발생한다.

아래 차트에서 2월 21일 매수시점이라고 하면 주가 상승전에 긴 꼬리 양봉이 자주 발생하는 것을 확인할 수 있습니다.

켄코아에어로스페이스 시 18,000 고 18,950 저 16,750 중 17,200 ▼1,150 -6.27% 거 3,452,732

이동평균 5 20 60 120



- 주가지수보다 더 좋은 수익율을 자주 보여준다.

아래 2월 14일을 매수 시점으로 본다면 주가지수가 계속 하락하는 구간에서도 지에스이(S&P 500)의 주가는 우상향하고 있었습니다.

지에스이 시 3,230 고 3,990 저 3,145 종 3,850 ▲760 +24.60% 거 89,112,303

● 지에스이 3,850 +24.60%

● 코스닥 889 -2.84% ✕

