

키움 증권 트레이딩 시스템 개발

Open API

매매 자동화 시스템 흐름

Example

매수 : 장 시작 후 상승률 0.5% 이상은 추가 상승력을 기대, 신규매수

매도 : 수익 5% 이상 : 익절 / 손익 -5%이하 : 손절

자동화 부분을 담당

매매 포트폴리오 구성

매수용 포트폴리오 : 전날 전략을 통과한 종목들

매도용 포트폴리오 : 현재 내가 홀딩중인 모든 종목들

전체 시장 or 내가 조회하고 싶은 종목 코드 구성

TR조회하여 전략에 들어맞는 종목 탐색

오전 8:45

장 중

장 시작 전

장 종료 후

윈도우 작업 스케줄러를 통해

매매 프로그램 자동 실행

매수용 포트폴리오 중 특정 종목이 매수 조건에 통과하면 매수신호 입력

매도용 포트폴리오 중 특정 종목이 매도 조건에 통과하면 매도신호 입력

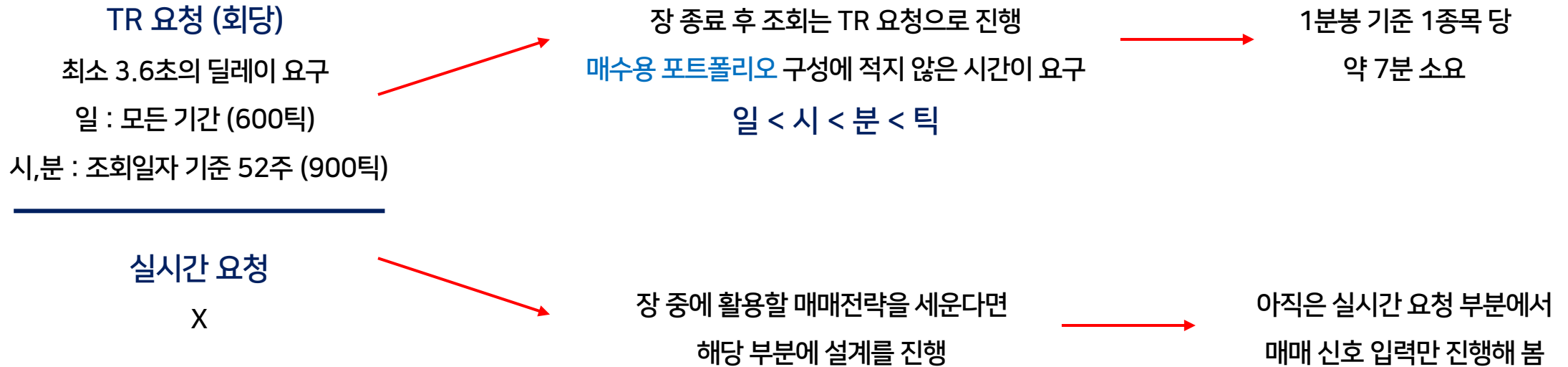
매도용 포트폴리오는 장 시작 직전 내가 보유중인 모든 종목으로 구성

장 종료 후 두 포트폴리오는 모두 초기화

Example

현재 주가가 n일 이동평균선 아래에 있어
저평가 된 종목이라 판단 매수용 포트폴리오에 저장

데이터 요청에 소요되는 시간



데이터 요청에 소요되는 시간

```

/*****
/// ##### Open API 함수를 이용한 전문처리 C++용 샘플코드 예제입니다.

[ opt50028 : 선물틱차트요청 ]

[ 주의 ]
데이터 건수를 지정할 수 없고, 데이터 유무에 따라 한번에 최대 900개가 조회됩니다.

1. Open API 조회 함수 입력값을 설정합니다.
   종목코드 = 전문 조회할 종목코드
   SetInputValue("종목코드" , "10100000");

   시간단위 = 1틱:1, 3틱:3, 5:5, 10:10, 20:20, 30:30, 60:60, 120:120
   SetInputValue("시간단위" , "10");

2. Open API 조회 함수를 호출해서 전문을 서버로 전송합니다.
   CommRqData( "RQName" , "opt50028" , "0" , "화면번호");

*****/

```

속성	조회	다음
opt50028 : 선물틱차트요청 설정		
종목코드	10100000	
시간단위	10	

출력

여기에 전문 조회 데이터가 표시됩니다.

```

[ 0] [opt50028 종목코드 = 101T6000]
[ 1] [opt50028 마지막틱갯수 = 2]
[ 0] [ 0] [opt50028 현재가 = 310.10]
[ 0] [ 1] [opt50028 거래량 = 10529]
[ 0] [ 2] [opt50028 체결시간 = 20230315153459]
[ 0] [ 3] [opt50028 시가 = 310.35]
[ 0] [ 4] [opt50028 고가 = 310.35]
[ 0] [ 5] [opt50028 저가 = 310.10]
[ 0] [ 6] [opt50028 전일종가 = ]
[ 1] [ 0] [opt50028 현재가 = 310.35]

```

출력

여기에 전문 조회 데이터가 표시됩니다.

```

[ 0] [opt50028 종목코드 = 101T6000]
[ 1] [opt50028 마지막틱갯수 = 2]
[ 0] [ 0] [opt50028 현재가 = 310.10]
[ 0] [ 1] [opt50028 거래량 = 10529]
[ 0] [ 2] [opt50028 체결시간 = 20230315153459]
[ 0] [ 3] [opt50028 시가 = 310.35]
[ 0] [ 4] [opt50028 고가 = 310.35]
[ 0] [ 5] [opt50028 저가 = 310.10]
[ 0] [ 6] [opt50028 전일종가 = ]
[ 1] [ 0] [opt50028 현재가 = 310.35]

```

```

/*****
/// ##### Open API 함수를 이용한 전문처리 C++용 샘플코드 예제입니다.

[ opt50028 : 선물틱차트요청 ]

[ 주의 ]
데이터 건수를 지정할 수 없고, 데이터 유무에 따라 한번에 최대 900개가 조회됩니다.

1. Open API 조회 함수 입력값을 설정합니다.
   종목코드 = 전문 조회할 종목코드
   SetInputValue("종목코드" , "101T6000");

   시간단위 = 1틱:1, 3틱:3, 5:5, 10:10, 20:20, 30:30, 60:60, 120:120
   SetInputValue("시간단위" , "10");

2. Open API 조회 함수를 호출해서 전문을 서버로 전송합니다.
   CommRqData( "RQName" , "opt50028" , "0" , "화면번호");

*****/

```

속성	조회	다음
opt50028 : 선물틱차트요청 설정		
종목코드	101T6000	
시간단위	10	

출력

여기에 전문 조회 데이터가 표시됩니다.

```

[ 0] [opt50028 종목코드 = 101T6000]
[ 1] [opt50028 마지막틱갯수 = 2]
[ 0] [ 0] [opt50028 현재가 = 310.10]
[ 0] [ 1] [opt50028 거래량 = 10529]
[ 0] [ 2] [opt50028 체결시간 = 20230315153459]
[ 0] [ 3] [opt50028 시가 = 310.35]
[ 0] [ 4] [opt50028 고가 = 310.35]
[ 0] [ 5] [opt50028 저가 = 310.10]
[ 0] [ 6] [opt50028 전일종가 = ]
[ 1] [ 0] [opt50028 현재가 = 310.35]

```

출력

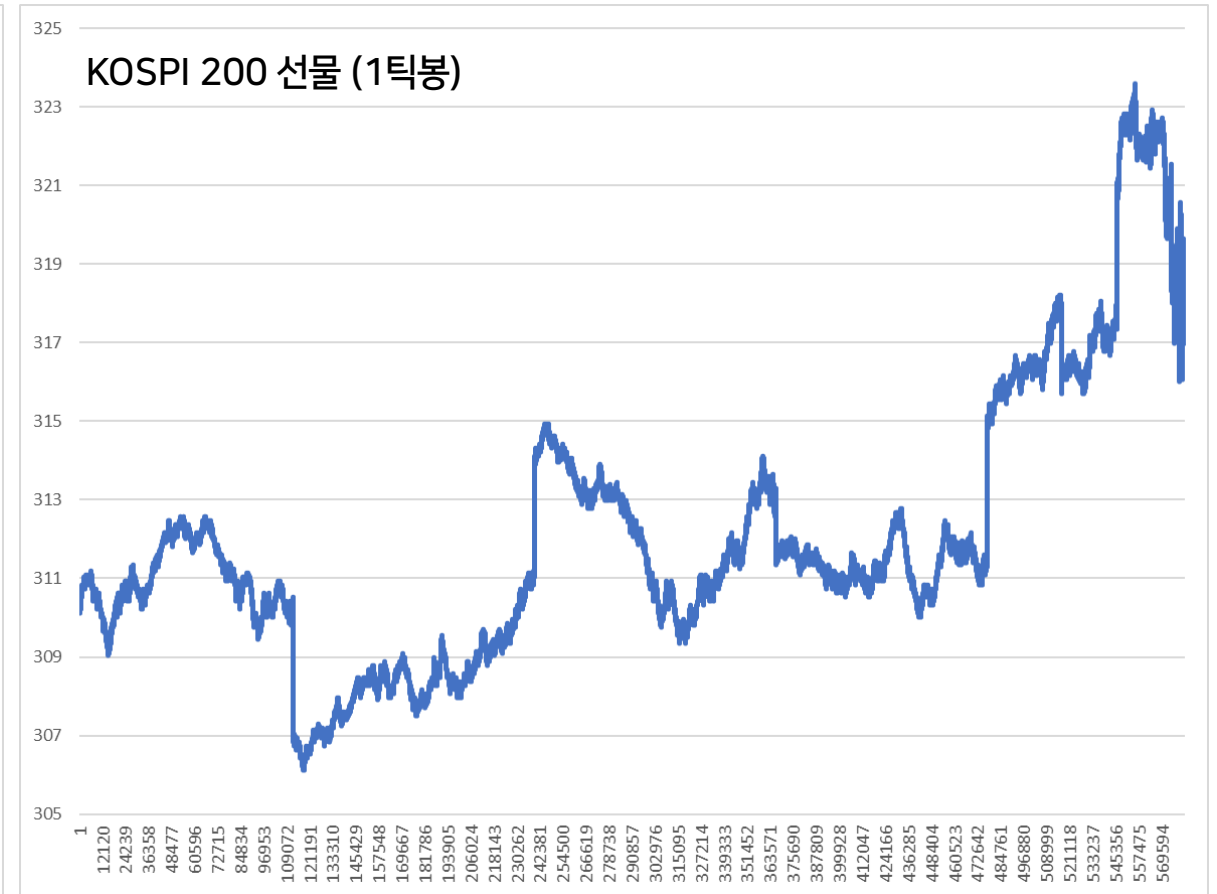
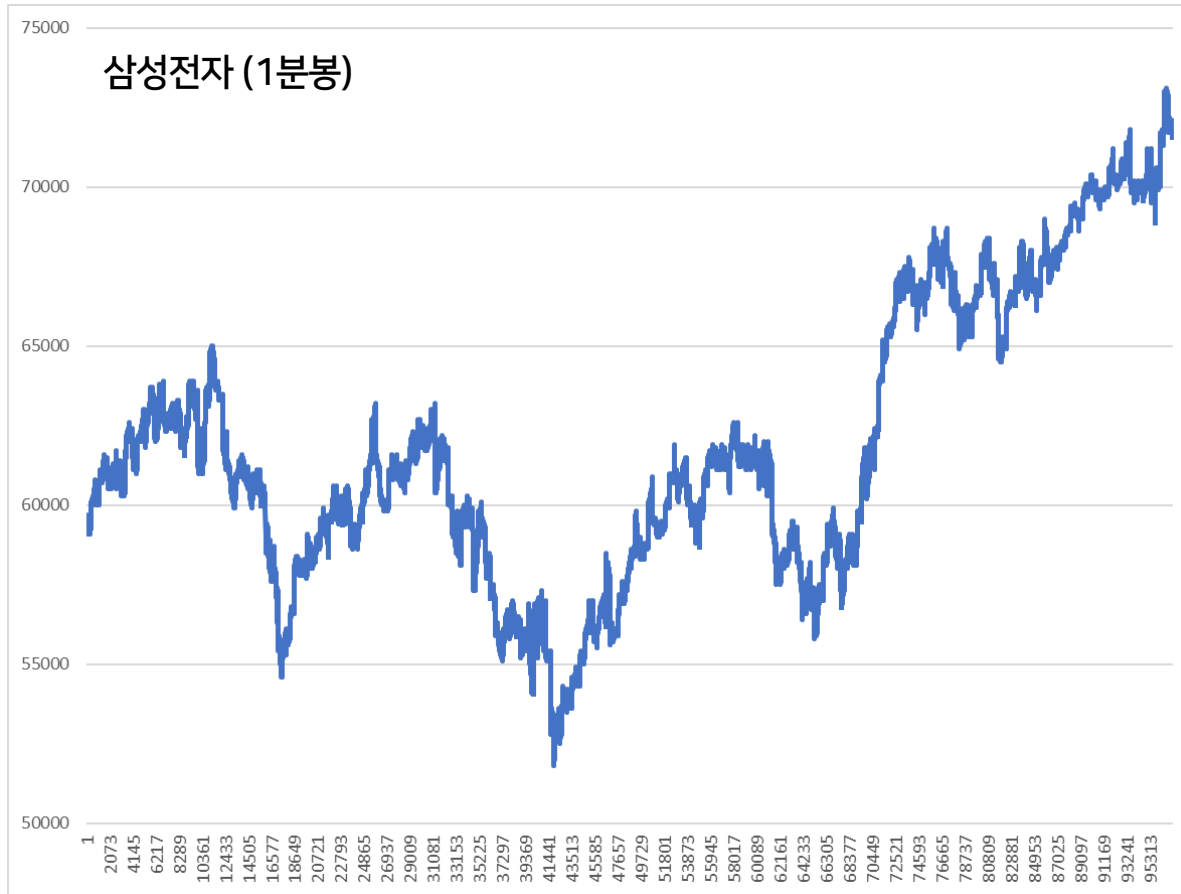
여기에 전문 조회 데이터가 표시됩니다.

```

[ 0] [opt50028 종목코드 = 101T6000]
[ 1] [opt50028 마지막틱갯수 = 2]
[ 0] [ 0] [opt50028 현재가 = 310.10]
[ 0] [ 1] [opt50028 거래량 = 10529]
[ 0] [ 2] [opt50028 체결시간 = 20230315153459]
[ 0] [ 3] [opt50028 시가 = 310.35]
[ 0] [ 4] [opt50028 고가 = 310.35]
[ 0] [ 5] [opt50028 저가 = 310.10]
[ 0] [ 6] [opt50028 전일종가 = ]
[ 1] [ 0] [opt50028 현재가 = 310.35]

```

TR 요청을 통해 수집한 데이터 예시



KOSPI 200 선물과 미니 KOSPI 200 선물의 차이점

	코스피 200 선물	미니 코스피 200 선물
거래 단위	코스피 200 선물가 * 25만	미니 코스피 200 선물가 * 5만
결제 월	3, 6, 9, 12월 (분기)	매월
가격 표시	코스피 200 선물 수치	미니 코스피 200 선물 수치
호가 가격 단위	0.05 point	0.02 point
최소 가격 변동 금액	12,500원 (25만 * 0.05)	1,000원 (5만 * 0.02)
최종 거래일	각 결제 월 두 번째 목요일	각 결제 월 두 번째 목요일
최종 결제일	최종 거래일의 다음날	최종 거래일의 다음날
가격 제한 폭	기준가 대비 각 단계별 확대 적용 ① ±8% ② ±15% ③ ±20%	기준가 대비 각 단계별 확대 적용 ① ±8% ② ±15% ③ ±20%
정산가격	최종 약정가격	분기월 : 코스피200선물의 정산가격(호가가격단위 미조정) 비분기월 : 코스피200선물의 정산가격 산출방식을 차용한 자체 가격
기준 가격	전일 정산가	분기월 : 코스피200선물의 기준가격(호가가격단위 조정) 비분기월 : 미니 코스피200선물의 전일정산가격

기초자산명		위탁(유지)증거금률	승수	최소증거금	스프레드 (유지)위탁 증거금율
KOSPI200	선물	9.450% (6.300%)	250,000	250,000	1.8% (1.2%)
	옵션	9.450% (6.300%)	250,000	250,000	-
	위클리옵션	9.450% (6.300%)	250,000	250,000	-
	미니선물	9.450% (6.300%)	50,000	50,000	1.8% (1.2%)
	미니옵션	9.450% (6.300%)	50,000	50,000	-