**IDCM 물량확보 자동매매 로직(안)**

목 차

[1 기본 사항 3](#_Toc89819918)

[1.1 요약 3](#_Toc89819919)

[1.2 Cascade 구성도 4](#_Toc89819920)

[2 진입 로직 5](#_Toc89819921)

[2.1 초기 진입 5](#_Toc89819922)

[2.2 Cascade 형태 진입 6](#_Toc89819923)

[2.3 사용자 설정 사항 7](#_Toc89819924)

[3 참고 사항 8](#_Toc89819925)

**IDCM 물량확보 자동매매로직(안)**

2021년 12월 8일

# 기본 사항

## 요약

* 목표
  + 물량 보유 시 평균 진입가 대비 보유 물량 상대적 증대
  + 물량 모두 청산 시 초기 자본금 대비 최종 자본금 증대
* 투자 구성
  + 초기 진입
    - 로직 적용 후 가장 먼저 수행
    - 진입 물량과 가격은 Cascade 진입 포지션과는 별도의 독립 포지션
  + Cascade[[1]](#footnote-1) 진입
    - 초기 진입 이후 수행
    - 하나 또는 다수의 Grid 세트들로 구성
    - Grid 간격 및 물량은 사용자 설정
  + 청산은 TakeProfit 또는 TrailingStop 설정 값에 따라 수행
* 투자 성향 (TBD)
  + 보수형, 중립형, 공격형 형태로 구분
  + 각 성향 구분은 사용자 설정 사항 값으로 조정
  + 레버리지 적용이 가능하다면 레버리지 비율로 추가 조정

## Cascade 구성도

Grid N

…

…

…

Grid 3

Grid 2

Grid 1

**상승 Grid Set N**

**Cascade**

Grid N

…

…

…

Grid 3

Grid 2

Grid 1

**상승 Grid Set 1**

**상**

**승**

Grid N

…

…

…

Grid 3

Grid 2

Grid 1

**상승 Grid Set 2**

Grid N

…

…

…

Grid 3

Grid 2

Grid 1

**…**

**하락 Grid Set 1**

Grid 1

Grid 2

Grid 3

…

…

…

Grid N

**하락 Grid Set 2**

Grid 1

Grid 2

Grid 3

…

…

…

Grid N

**하락 Grid Set N**

Grid 1

Grid 2

Grid 3

…

…

…

Grid N

**…**

Grid 1

Grid 2

Grid 3

…

…

…

Grid N

**하**

**락**

**로직**

**적용**

**가격**

* Grid 세트는 진입 시점 가격 기준으로 상승/하락으로 구분하여 순차적으로 수행

# 진입 로직

## 초기 진입

* 로직 적용 후 설정한 가격과 물량 최초 진입
* 초기 진입 가격과 설정은 이후 진행할 Cascade 로직과는 독립적인 포지션
* 초기 진입 물량의 청산은 별도의 TakeProfit이나 TrailingStop 설정으로 수행

<예>

|  |
| --- |
| 초기 자본금: $10만  초기 진입 가격: 로직 적용 즉시  초기 진입 물량: 초기 자본금 50%  매도 호가(Bid): $5천  TakeProfit: $1만  진입: 매도호가(Bid) $5천에 물량 10 진입  청산: 매수호가(Ask) $1만 도달 시 물량 10 청산 |

## Cascade 형태 진입

* “초기 진입” 이후 독립적으로 Grid 세트로 구성된 Cascade 형태 진입
* 초기 Grid 진입
  + 첫 Grid 세트 진입
  + 초기 진입 이후 Grid 설정 가격 도달 시 진입
  + 이후 Grid 세트 가격은 초기 Grid 진입 가격을 기준으로 수행
* 첫 Grid 세트 진입 완료 후 추가 Grid 세트 진입
  + 추가 Grid 별 설정(Grid 간격, Grid 진입 물량) 적용
  + 추가 Grid 세트 구성은 초기 Grid 진입 가격을 기준으로 하락 시와 상승 시로 나누어 구성
  + 하락 시 Grid 설정과 상승 시 Grid 설정은 독립적으로 적용
* 첫 Grid 진입 가격 기준으로 하락/상승 시
  + 하락 시 Grid 간격과 물량 증가 배수(Multiplier) 설정
  + 물량 증가 배수(Multiplier)는 직전 진입 물량을 기준으로 적용

***(예:***

***초기 물량: 1, Multiplier:2, Grid 간격: 400틱인 경우***

***Grid 시작 시점 가격에서 Grid1 물량 1 진입***

***Grid1 진입가에서 400틱 하락 Bid 도달 시 Grid2 물량 2 (1\*2) 진입***

***Grid2 진입가에서 400틱 하락 Bid 도달 시 Grid3 물량 4 (2\*2) 진입***

* + Grid 세트 진입 완료 시 다음 Grid 세트 진입 수행

***(예:***

***Grid Set1의 Grid 개수가 7개이고 진입 완료된 경우 Grid Set2 를 수행***

## 사용자 설정 사항

* 초기 진입 구성
  + 진입 가격[[2]](#footnote-2): 로직 적용 즉시
  + 진입 물량[[3]](#footnote-3): 초기 자본금 대비 %
* Cascade 진입[[4]](#footnote-4)
  + Grid 세트 개수
  + Grid 세트별 Grid 간격
  + Grid 세트별 Grid 개수
  + Grid 세트별 초기 물량
  + Grid 세트별 물량 증가 배수
  + Grid 세트 간 간격
* 청산
  + 목표이익가(TakeProfit) [[5]](#footnote-5)
    - 초기 진입 포지션에 대한 설정
    - Cascade 포지션에 대한 설정

# 참고 사항

* 사용자 설정 사항은 향후 운영 상황에 따라 세분화 가능
* 초기 진입 포지션 청산과 Cascade 포지션 청산은 독립적으로 수행
* 초기 진입 가격 이후 Cascade 초기 진입 가격까지의 간격 설정

1. 하나 또는 다수의 Grid들로 구성 [↑](#footnote-ref-1)
2. TBD: 1)고정 자본금, 2)고정 물량 [↑](#footnote-ref-2)
3. TBD: 1)특정 가격, 2)특정 지표 값 [↑](#footnote-ref-3)
4. 상승/하락 별로 구분하여 설정 [↑](#footnote-ref-4)
5. 값이 0이면 청산하지 않음 [↑](#footnote-ref-5)