

00

차 례



종 합 설 계 개 요 관 련 연 구 및 사 례 수 행 시 나 리 오 시 스 템 시 템 성 도 스 모 듈 상 세 시 스 템 설계 환 경 개 발 및 개 발 방 법 데 환 계 모 경 설 업 무 담 분 설 계 종 합 일 정 수 행 필요기술 및 참 고 문 헌



00

종합 설계 개요

❖ 연구 개발 배경

- ▶ 시스템 트레이딩의 수요 증가
- ▶ 레이블링 기술의 중요성 증가

❖ 연구 개발 목표

- 시계열 데이터 레이블링
- ▶ 거래 전략 개발
- > 자동 거래 구현
- ▶ 다 종목 시뮬레이션 가능

❖ 연구 개발 효과

- 주식과 관련된 레이블링 데이터 제공
- > 유동적인 전략 생성과 검증이 가능하다.





종합설계 개요

Sequence Labeling

- ▶ 적용 분야
 - ✓ DNA 암기 서열 분석
 - ✓ 자연어 처리
 - ✔ 음성 및 동작 인식
- -> 즉 Sequence로 해석될 수 있는 어떠한 종류의 데이터 처리
- ▶ 시계열 데이터
 - ✓ 하나 또는 여러 사건에 대해 시간의 흐름에 따라 일정한 간격으로 관찰하여 기록한 Sequence Data
 - ✔ 예시) 주식 데이터, 날씨 데이터, 센서 데이터
 - ✓ 장점
 - 시간이 지남에 따라 어떻게 달라지는지 명확함
 - 발생 추세가 명확함
 - 예측 모델링 및 예측에 가장 적합함

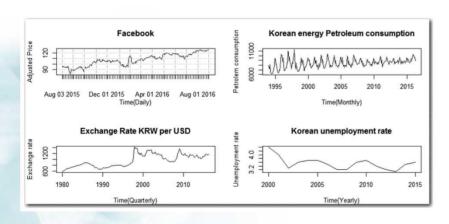




종합설계 개요

Sequence Labeling

- > Stock Charts에서의 Labeling
 - ✓ 시계열 데이터의 각 지점에 identity를 표시
 - ✓ 어떤 시간 t에 발생한 데이터는 t 앞뒤의 데이터로 부터 의존적
 - ✓ t 앞뒤의 데이터를 분해 및 해석하여 범주형 변수 Labeling
 - ✓ Labeling한 데이터를 활용하여 다양한 거래 전략 생성
 - ✓ 추세 분해, 주기 분해, 기술적 지표, 특성 단순화 등을 활용



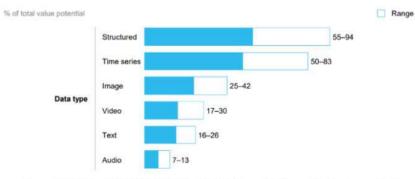


Figure 1. 데이터 유형에 따른 잠재적 인공지능 활용 가치 (Source: McKinsey Global Institute analysis)





❖ 예스트레이더 - 예스랭귀지

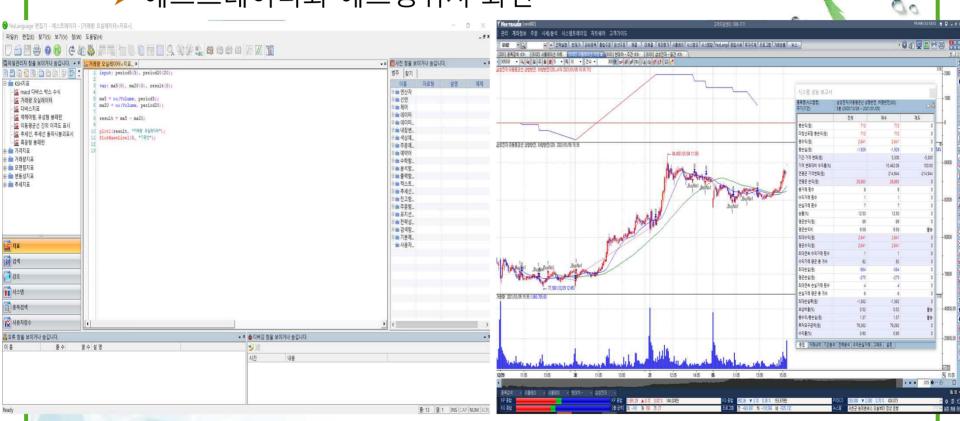
- 프로그매에서 기본 제공하는 지표나 전략을 사용하거나 사용자가 지표나 전략을 새로 생성할 수 있다.
- ▶ 시뮬레이션(가상매매), 성능평가 기능을 통해 지표와 전략을 투자 종목에 적용할 수 있다.

▶ 단점

- ✓ 외부데이터를 추가하여 사용할 수 없다.
- ✔ 시뮬레이션을 하나의 종목에 대해서만 적용할 수 있다.

❖ 예스트레이더

▶ 예스트레이더와 예스랭귀지 화면



KPU 한국산업기술대학교 컴퓨터공학부



❖ 예스트레이더 - 예스스팟

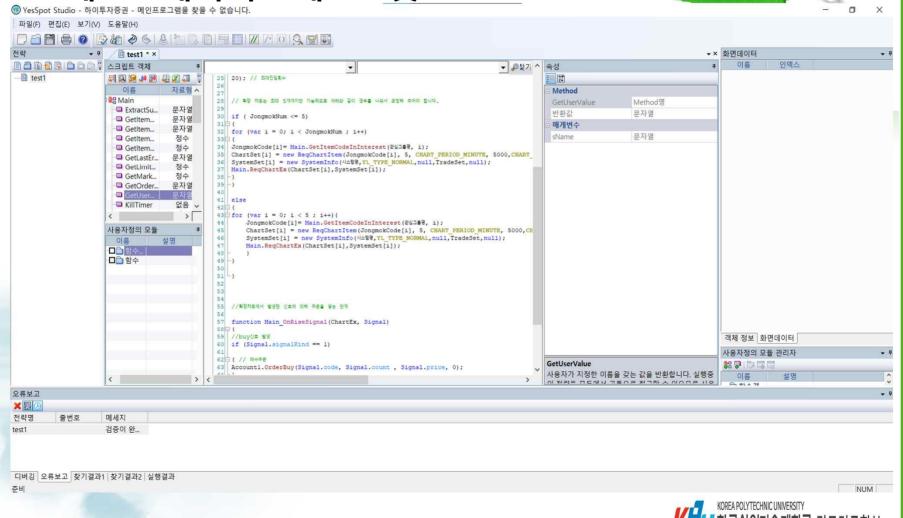
▶ 자바스크립트 기반 시스템 트레이딩 프로그램으로 예스랭귀지보다 더 자유롭게 개발자의 의도대로 흐름을 정할 수 있다.

▶ 단점

- ✓ 시뮬레이션은 불가능하다.
- ✓ 편의성이 떨어진다.
- ✓ 자바스크립트 활용능력이 필요하다.



❖ 예스트레이더 - 예스스팟





❖ 뉴지스탁 – 젠포트

- ▶ 프로그램에서 제공하는 전략을 조합하여 알고리즘 트레이딩을 할 수 있는 프로그램이다.
- ➤ 코딩을 하지 않고 Drag&Drop 방식으로 투자 전략을 생성할 수 있다.
- 투자 종목을 다양한 기준으로 선정하여 시뮬레이션이 가능하다.

▶ 다점

- ✓ 사용자가 새로운 지표나 전략을 자유롭게 생성할 수 없다.
- ✓ 시뮬레이션 사용이 유료이다.(일봉, 틱 백테스트 각각 일 1회 무료)
- ✔ 시뮬레이션은 일봉에 대해서만 지원한다.
- ✓ 외부데이터 사용이 불가능하다.
- ✓ 2007년 이전 데이터로는 백테스팅이 불가능하다.





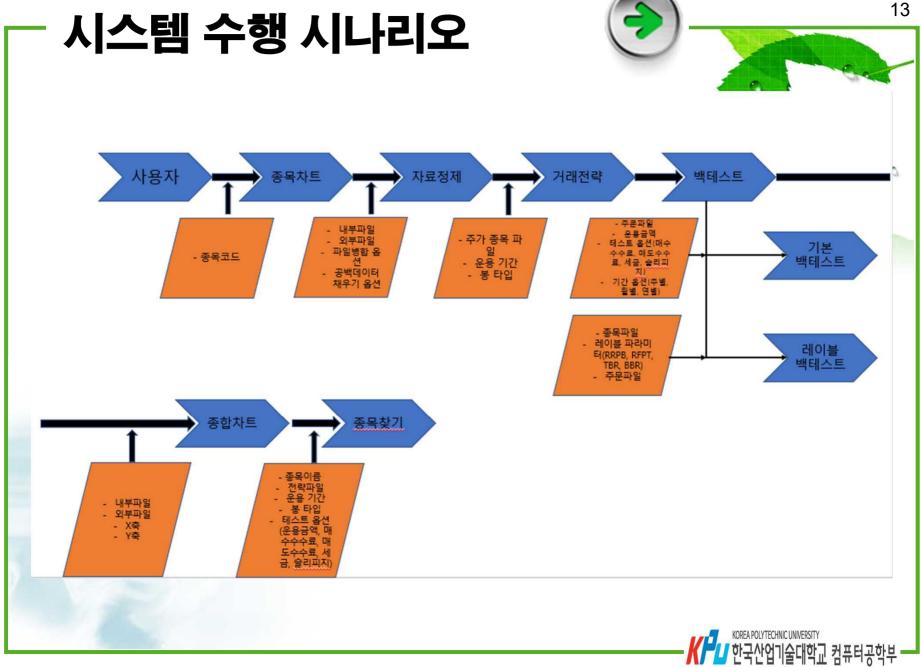


❖ 차별성

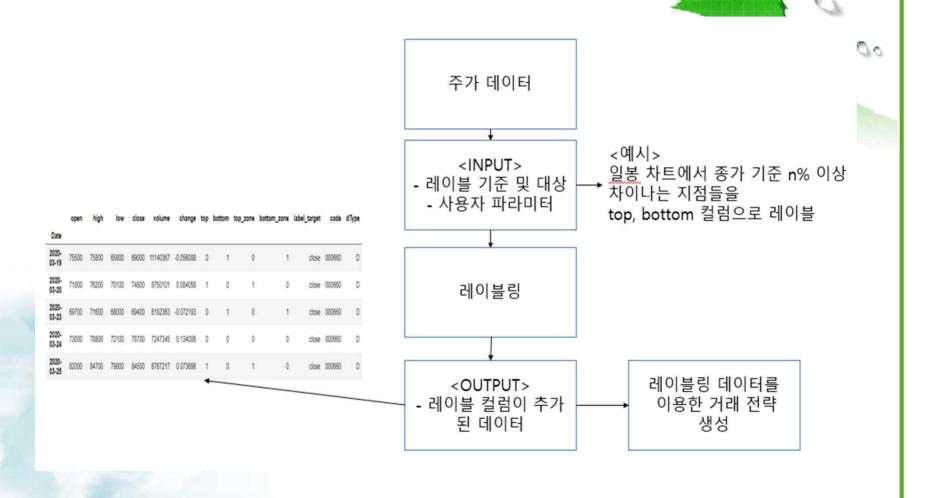


예스 트레이더	예스 스팟	젠포트	목표 시스템				
- 한 가지 전략에 대해 다양한 종목 시뮬레이션이 불가 능	- 불가능	- 2007년 과거 데 이터로 시뮬레이션 이 불가능 - 시뮬레이션 사용 이 유료	 한 가지 전략으로 다 종목 시뮬레이션이 가능하다. 과거 모든 데이터 시뮬레이션 가능 				
예스랭귀지 학습 필요(난이도: 중)	자바스크립트 학습 필요(난이도: 상)	사용자 수식 작성 불필요하므로 쉬움 (난이도: 하)	파이썬 언어를 기 반으로 한 조건문 학습 필요				
가능	가능	불가능	가능				
불가능	주가 데이터	불가능	시계열 데이터 및 레이블 데이터				
	- 한 가지 전략에 대해 다양한 종목 시뮬레이션이 불가 능 예스랭귀지 학습 필요(난이도: 중)	- 한 가지 전략에 대해 다양한 종목 시뮬레이션이 불가능 에스랭귀지 학습 필요(난이도: 중) 자바스크립트 학습 필요(난이도: 상) 가능 가능	- 한 가지 전략에 대해 다양한 종목 시뮬레이션이 불가능 - 시뮬레이션 사용 이 유료 M- 2007년 과거 데 이터로 시뮬레이션 이 불가능 - 시뮬레이션 사용 이 유료 자바스크립트 학습 필요(난이도: 중) 자바스크립트 학습 (난이도: 하) 가능 가능 불가능				

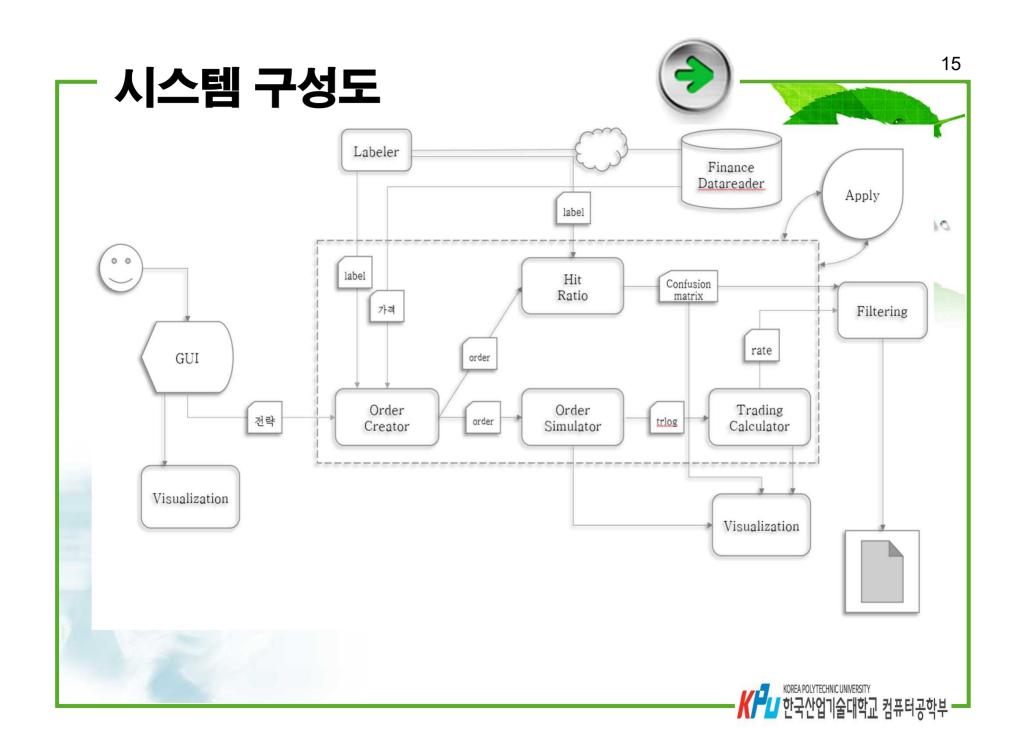




시스템 수행 시나리오 - 레이블







0. 모듈 목록

- gatherer: 주가 가격데이터 수집 및 저장하는 모듈
- indicator: 기술적지표 값을 생성하여 데이터프레임 컬럼에 추가하는 모듈
- labeler: 주가 차트의 지점들을 특정 범주 및 그룹으로 분류하는 모듈
- order_creator: 전략파일을 입력 받아 전략에 맞는 주문파일을 생성하는 모듈
- simulator: 주문파일을 이용하여 거래 시뮬레이션하는 모듈
- calculator: 거래내역을 입력 받아서 주(월, 연)간 수익률을 계산하는 모듈
- hit tester: 저점/고점 레이블링 데이터와 일치성의 정도를 비교하는 모듈
- GUI: 파일 입/출력, 차트 시각화 등을 수행하는 모듈



1. gatherer

- 주가 가격데이터 수집 및 저장하는 모듈
- Class: Gatherer()
- 사용 라이브러리: FinanceDataReader, Pandas
- · 멤버변수(public)
 - df_krx: 한국거래소에 상장된 종목정보 데이터프레임







2. indicator

- 기술적지표 값을 생성하여 데이터프레임 컬럼에 추가하는 모듈
- Class: 없음, 함수로만 모듈 구성
- 사용 라이브러리: ta-lib
- 지원하는 지표:
 - 볼린저밴드
 - RSI
 - MACD
 - MA(이동평균)
 - EMA(지수이동평균)
 - CMO(샹드 모멘텀 오실레이터)
 - 스토캐스틱
 - 스토캐스틱 패스트
 - ATR
 - Super Trend
 - Clustering





3. Labeler

- 주가 차트의 지점들을 특정 범주 혹은 그룹으로 분류하는 모듈
- 레이블링 데이터는 전략 개발 과정 및 전략 검증 과정에서 사용할 수 있다.
- Class: 없음, 함수로만 모듈 구성
- 사용 라이브러리: ta-lib
- 지원하는 레이블러:

✓ candles

- 캔들 종류(Candle Type)
- 캔들 모양(Candle Shape)

✓ cross

- 이동평균 크로스(MA Cross)
- 이중지수이동평균 크로스 (DEMA Cross)
- 거래량가중이동평균 크로스(VWMA Cross)
- 이동평균수렴확산지수 크로스(MACD Cross)
- 패스트-스토캐스틱 크로스(Fast-Stochastic Cross)
- 슬로우-스토캐스틱 크로스(Slow-Stochastic Cross)

✓ Classification

- 적삼병(Three white soldiers)
- 흑삼병(Three black crows)
- 볼린저 밴드(Bollinger Bands)
- 가격 변화 비율(Rate Of Change)
- 탑바텀: top_bottom





4. order_creator

- 전략파일을 입력 받아 전략에 맞는 주문파일을 생성하는 모듈
- Class: OrderCreator
- 사용 라이브러리: FinanceDataReader, Pandas
- 멤버변수(public)
 - mode
 - True: network, False: local
 - · Type: boolean
 - order_requests
 - Request(Class)로 생성된 객체들을 listtype으로 모아둠
 - type: list of Request(instance)
- 멤버변수(private)
 - trade_list
 - 전략식을 만족하여 주문에 필요한 정보들의 리스트를 담은 리스트
 - type: list



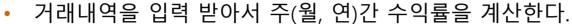
5. simulator

- 주문파일을 이용하여 거래 시뮬레이션하는 모듈
- 주식종목, ETF, 가상화폐(미구현)에 대해서 시뮬레이션이 가능하다.
- Class: Simulator
- 사용 라이브러리: FinanceDataReader, Pandas
- 멤버변수(public)
 - _trd_log
 - 거래기록을 저장하는 DataFrame
 - _stu_log
 - 상태를 저장하는 DataFrame
 - cash
 - 자본금을 저장한다.
 - order sheet
 - 주문내역이 들어있는 데이터프레임
 - DataFrame화한 주문서(파일)를 저장한다.
 - buying fee
 - 매도 수수료
 - _selling_fee
 - 매수 수수료
 - _national_tax
 - 국가 세금
 - weigh
 - 매도 수수료 + 매수 수수료 + 국가 세금
 - slippage
 - slippage 값을 저장한다.
 - _connect_network
 - 네트워크 연결 여부를 저장한다.
 - stock name
 - 종목이름을 저장한다.





6. calculator



- Class: Calculator
- 사용 라이브러리: FinanceDataReader, Pandas
- · 멤버변수(public)
 - _wast_log
 - 주간 수익률을 기록하는 DataFrame
 - _mast_log
 - 월간 수익률을 기록하는 DataFrame
 - _yast_log
 - 연간 수익률을 기록하는 DataFrame
 - _dates
 - 거래 시작 날짜와 마지막 날짜 사이에 모든 날짜를 저장하는 리스트
 - weeks
 - 금요일에 해당하는 날짜를 저장하는 리스트
 - months
 - 월에 마지막 날짜를 저장하는 리스트
 - _years
 - 연에 마지막 날짜를 저장하는 리스트
 - stock name
 - 주가 종목이름을 저장
 - trd log
 - 거래 기록이 있는 데이터프레임
 - DataFrame화한 거래기록(파일)을 저장한다.
 - atlog
 - 손익률계산 결과를 담은 딕셔너리
 - {손익률 계산 날짜, 자산, 기간별 손익률, 누적 손익률}
 - type: dictionary





7. hit_tester

- 가격레이블과 주문이 얼마나 일치하는지 비교한다.
- 사용 라이브러리: numpy









8. GUI

- 앞서 소개한 7개의 내부 모듈을 종합하여 GUI로 시각화 하여 사용자에게 전략 개발 서비스를 제공한다.
- 주식 차트를 시각화 하여 사용자가 보다 편리한 기술적 분석과 전략 개발을 할수 있도록 돕는다.

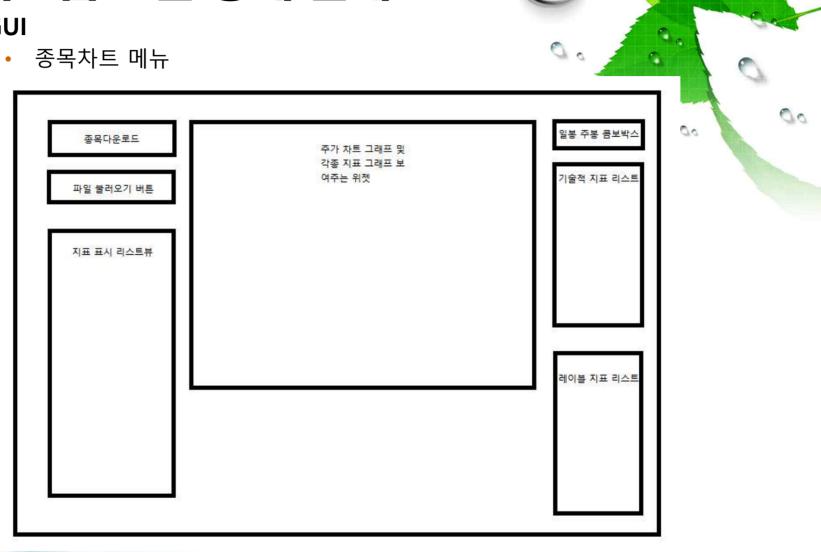


8. GUI





8. GUI





8. GUI

• 자료정제 메뉴







8. GUI

• 단순전략 메뉴 - 로컬파일모드







00

시스템 모듈 상세 설계

8. GUI

• 단순전략 메뉴 - 네트워크모드 전략 운용할 기간 입력받는 위젓 로컬파일모드 라디오버튼 네트워크모드 라디오버튼 일봉, 주봉 라디오버튼 박스 사용할 지표 보여주는 리스트 위젯 지표 선언식 텍스트뷰 거래 전략 편집기 텍스트뷰 전략 조건식 검증 버튼 주문 생성 버튼

· **《 Full** KOREA POLYTECHNIC UNIVERSITY 한국산업기술대학교 컴퓨터공학부 —

8. GUI

• 백테스트 메뉴 – 기본 백테스트



주문파일 입력받는 위젯 기간별 수익률, 자산흐름 그래프 보여주는 위젯 파일불러오기 버튼 운용금액 입력받는 위젯 백테스트 옵션 라디오버튼 박스 기간 옵션 라디오버튼 박스 백테스트 결과 통계자료표 테이블뷰



8. GUI

• 백테스트 메뉴 – 레이블 백테스트

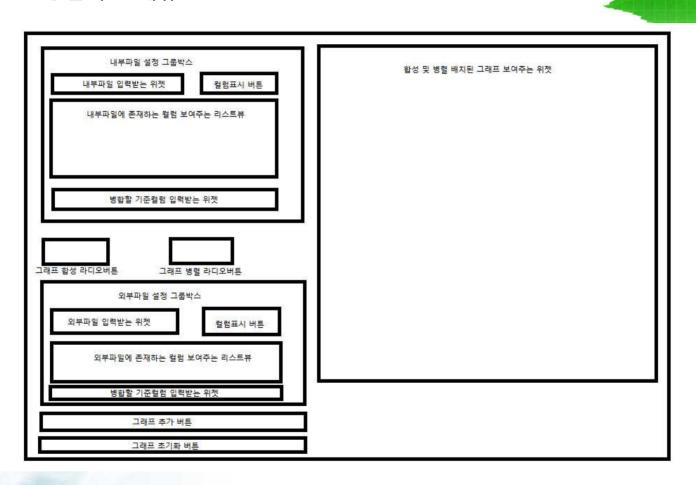


레이블된 그래프 보여주는 위젯 파일불러오기 버튼 레이블 데이터 파일 생성 버튼 레이블 파일 입력받는 위젯



8. GUI

• 종합차트 메뉴





개발 환경



구분		상세내용						
	OS	Windows 10						
	개발 환경(IDE)	VS code, Spyder						
S/W	개발 언어	Python						
개발 환경	프레임 워크	PySide2						
112 20	주요 라이브러리	matplotlib, plotly, PySide2, pandas,						
	T# 9 1=99	finance-datareader, ta-lib, Scikit-lean						
프로젝트	형상관리	Git, GitHub						
관리 환경	의사소통 관리	Notion						



개발 환경 (2)

- ❖ 졸업작품 GitHub 주소
 - https://github.com/

git

- ❖ 팀원 별 GitHub ID
 - ▶ 팀장:
 - ✓ ID:
 - ▶ 팀원:
 - ✓ ID:
 - ▶ 팀원:
 - ✓ ID:



개발 방법

1. Application

- 개발언어는 Python을 이용
- PySide2를 이용한 GUI 구현



2. Server 및 DB

- 라이브러리를 이용하여 데이터 수집 및 처리
- 각 모듈 별 파일 산출물 사용자 로컬 파일 디렉토리 저장



데모 환경 설계

❖ 데모 환경

- Windows 10
- Python 3.7

❖ 데모 방법

• GUI 프로그램으로 데모





업무 분담



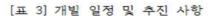
	Ī	Ī		
			00	00
자료수집	❖레이블 알고리즘 ❖트레이딩 전략	❖ 시각화 라이브러리 ❖ HTS	❖ 기술적 지표❖ 증권사 API	
설 계	❖ 시계열 데이터 분석 및 레이블링 모듈	❖ 프로그램 GUI 모듈	❖ 전략 개발 모듈	
구 현	❖ Data Labeling ❖ 종목 필터링	❖ GUI❖ Chart Visualization	❖ 전략 개발 및 검증 ❖ 거래 자동화	
테스트	❖ 모듈 별 테스트 및 디버❖ 모듈 통합 테스트 및 디			



종합설계 수행일정



eln erlilel	12	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	
항목	추진사항		월	월	월	월	월	월	월	월	월	월
계획 수립	- 전체 계획 수립											
요구사항	- 일고리즘 트레이딩											\Box
정의 및	자료 조사											
	- 시스템 트레이딩 툴											
분석	자료 조사											
	- stock data label											
	일고리즘 설계											
	- 전략 syntax 설계											
시스템 설계	- 주문모듈 설계											
	- simulation 설계											
	- 시각화 설계											
	- stock data label 구현											
프로토타입	- stock data gathering 구현											
구현	구현 - 주문모듈 구현 - simulation 구현											
	- visualization 구현											
	- 프로토타입의 결과 확인 및											
	오류 해결											\square
프로그램	- GUI											
구현	- 시스템 통합											
프로그램	- 시스템 시험 및 검증											
테스트												
최종마무리 작업	- 보고서 작성											
	- 시스템 문서화											
	- 발표 준비											
L D 자리	- 논문 작성											
논문 작성	- 산업 기술대전 참가											





필요기술 및 참고 문헌

- ❖ Ta-lib
 - http://mrjbq7.github.io/ta-lib/funcs.html
- YesStrock Yeslanguage
 - https://www.yesstock.com/
- ❖ 키움증권 API
 - https://www3.kiwoom.com/nkw.templateFrameSet.do?m=m140 8000000
- ❖ 뉴지스탁 젠포트
 - https://genport.newsystock.com/Main.aspx
- PySide2
 - https://pypi.org/project/PySide2/



