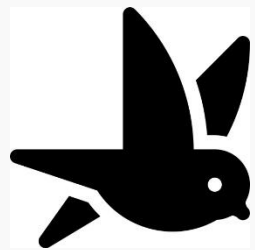


# 나만의 선물옵션 자동매매 프로그램

---

TEAM 놀부

이소담, 이 한, 장세종, 남궁지희



contents

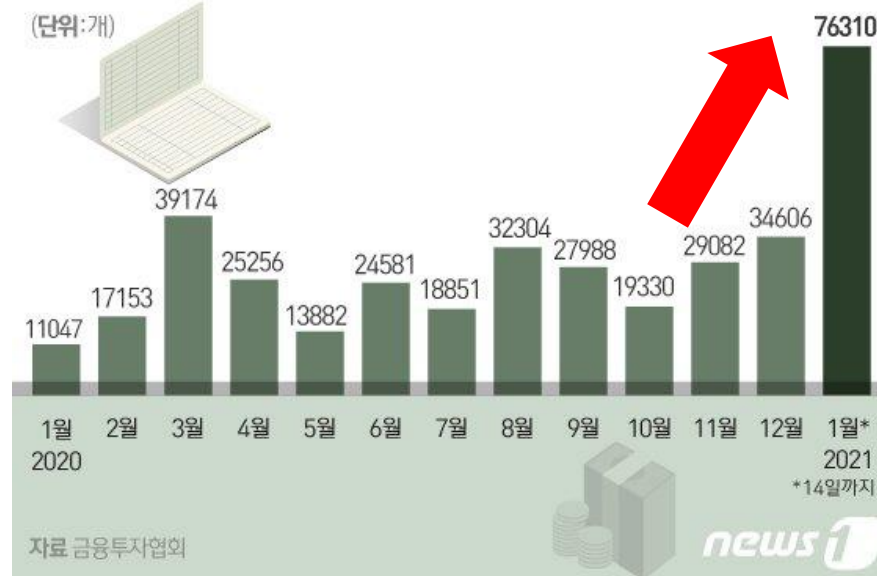
# 목 차

- 개요
- 주요 기능
- 흐름도
- 아웃풋
- 타임테이블
- 적용기술
- 시연 영상
- Q & A

## ○ 개인투자자 손실 증가함에 심리를 배제한 퀀트, 프로그램 매매 관심 상승

### 이용자 증가

2020년 월별 일평균 주식거래활동 계좌 증가수



### 수익률 부진

#### 지난달 개미 9조 샀지만...수익은 지지부진

삼성전자·SK하이닉스 등 매수  
반도체株 약세에 수익률 저조

기관은 삼성전자 8천억대 팔고  
삼바 등 기타 삼성株 사들여 수익

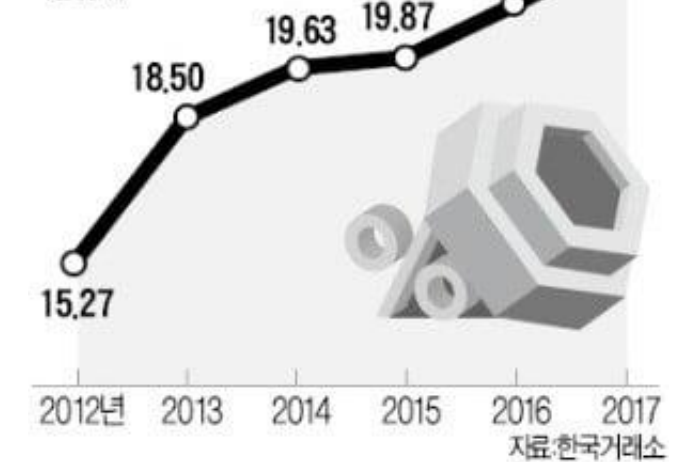
외국인 SKIET·포스코로 선방

김규식 기자 | 입력 : 2021.08.01 17:10:04 수정 : 2021.08.01 23:04:23

수익률 부진  
상당 퀀트 투자 리딩방

### 계량 투자 열풍

유가증권시장 거래대금 중  
프로그램매매 비중



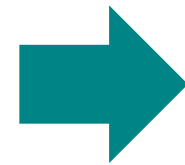
퀀트시장 약 1조 달러 규모

## 프로그램 자동매매

→ 계량적이고 객관적인 지표와 전략으로 미리 입력된 알고리즘으로 매매



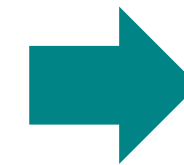
시황 파악 및 모델링



데이터 검증  
모델별 검증



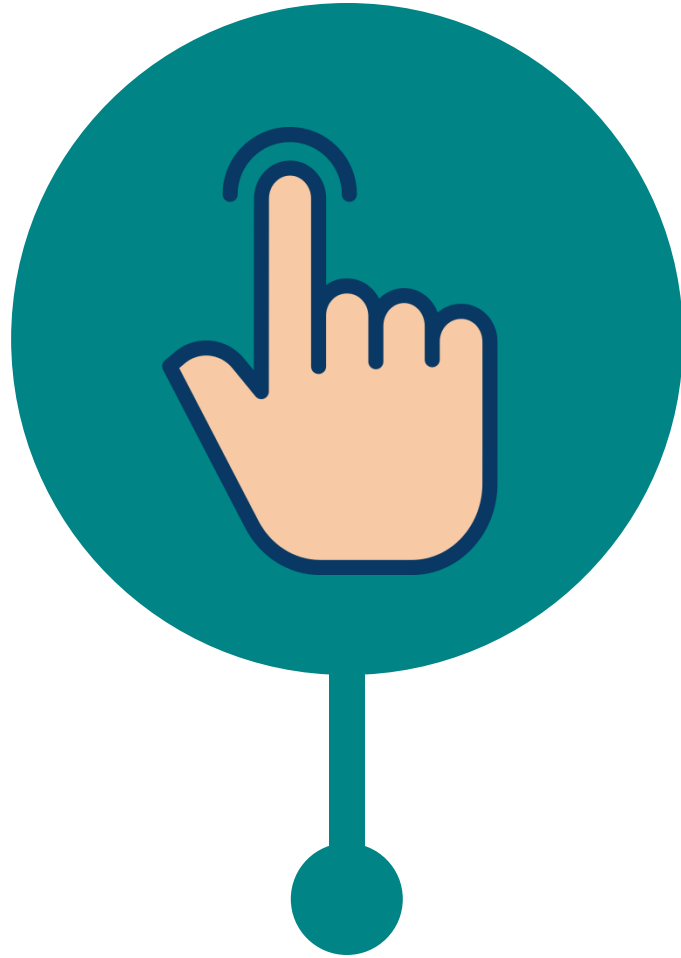
상품 및 포지션  
선택



매수/매도  
수익 실현



# 주요 기능



## 상품 선택

KOSPI200 선물  
미니 KOSPI200 선물  
KOSPI200 옵션  
KOSPI200 위클리 옵션



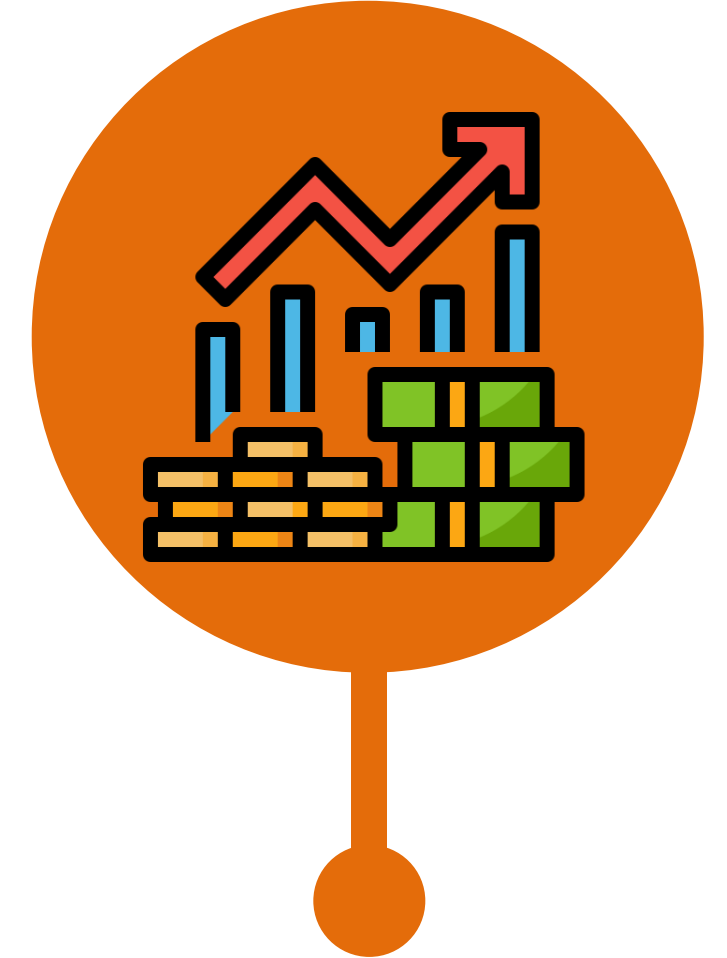
## 투자전략 검증

과거 데이터로  
투자전략에 맞는 포지션을  
찾고 가격 예측



## 모델링

선택된 상품, 포지션을  
각 모델별로 검증

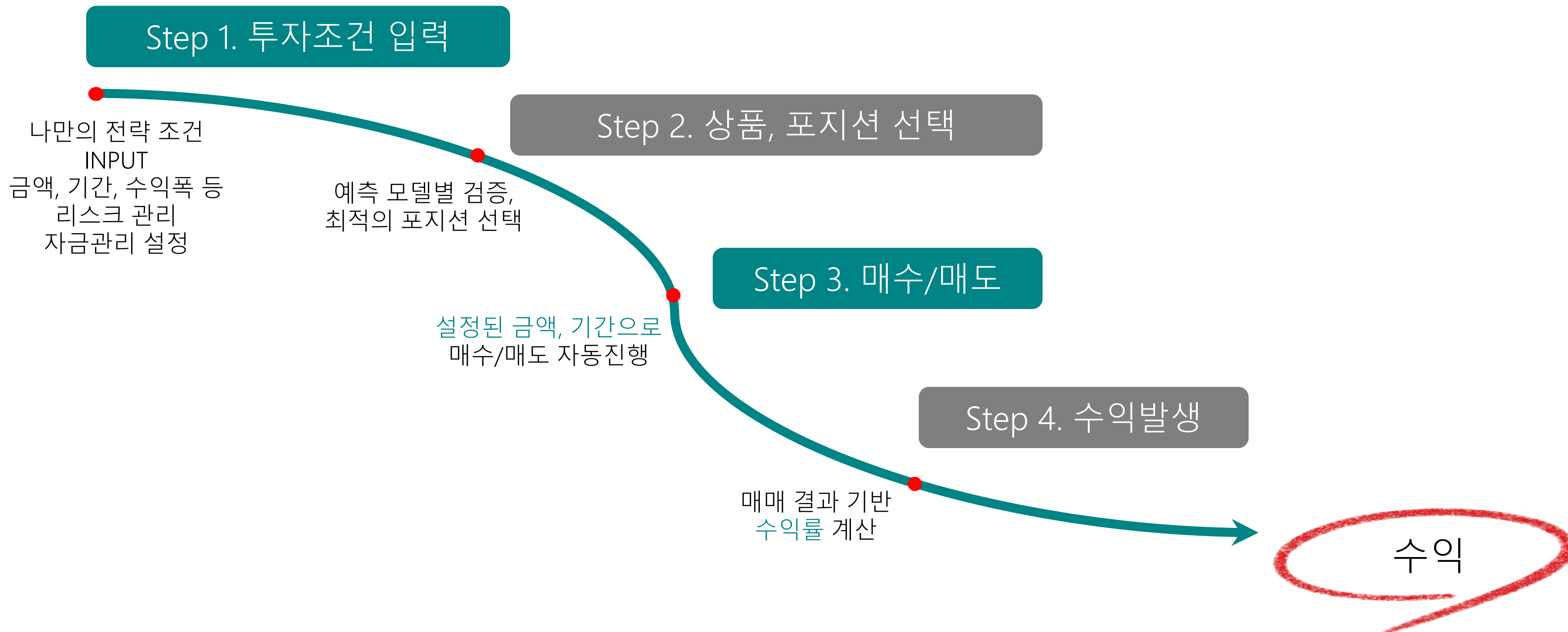


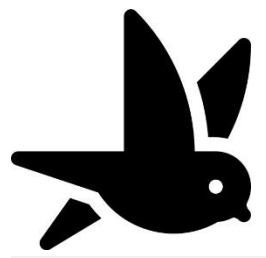
## 자동 매매

입력된 매매전략  
알고리즘으로 거래



# 자동매매 개요





# 자동매매 개요

## Step 1. 투자조건 입력

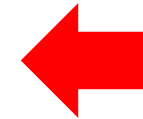
INPUT

투자전략

1. 운영 조건

2. 투자 금액

3. 상품 선택



운영조건

기간, 주기, 횟수, 위험관리, 자금관리

투자금액

계약 수, 거래 금액

상품선택

선물(코스피200, 미니코스피), 옵션(위클리) 등



# 자동매매 개요

## Step 2. 상품, 포지션 선택

상품선별

사용자 설정  
모델별 검증  
&  
나스닥, 항셱지수 앙상블

OUTPUT

모델별  
최적 포지션(매수/매도) 도출



매매시작







# 자동매매 개요

## Step 3. 매수/매도

INPUT

예측값  
모델링

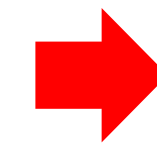
나스닥/ 항생지수 모델별 예측값 도출



N번 거래 반복

매매전략  
알고리즘

실시간 매매전략 알고리즘 실현



OUTPUT

## Step 4. 수익률 계산

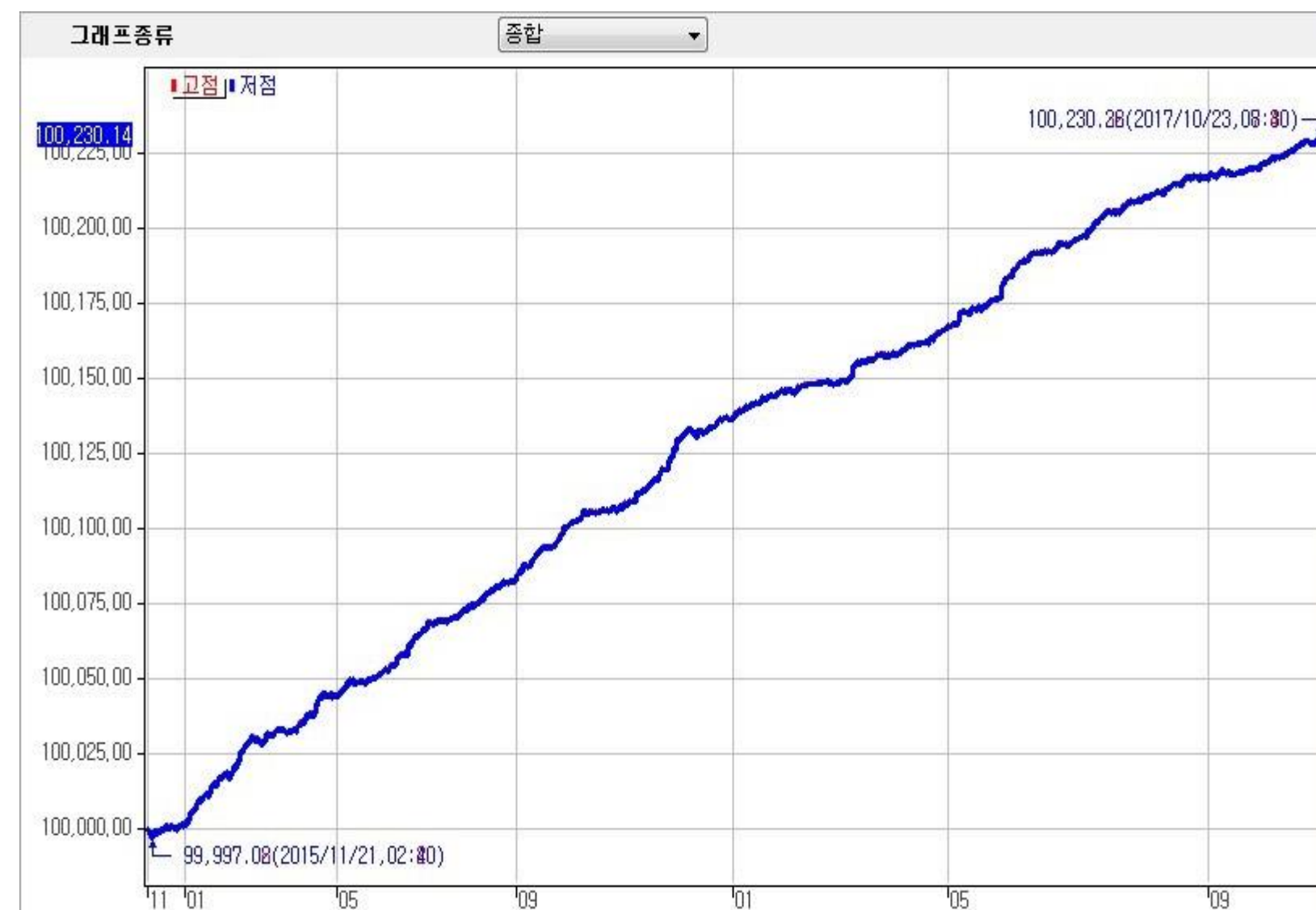
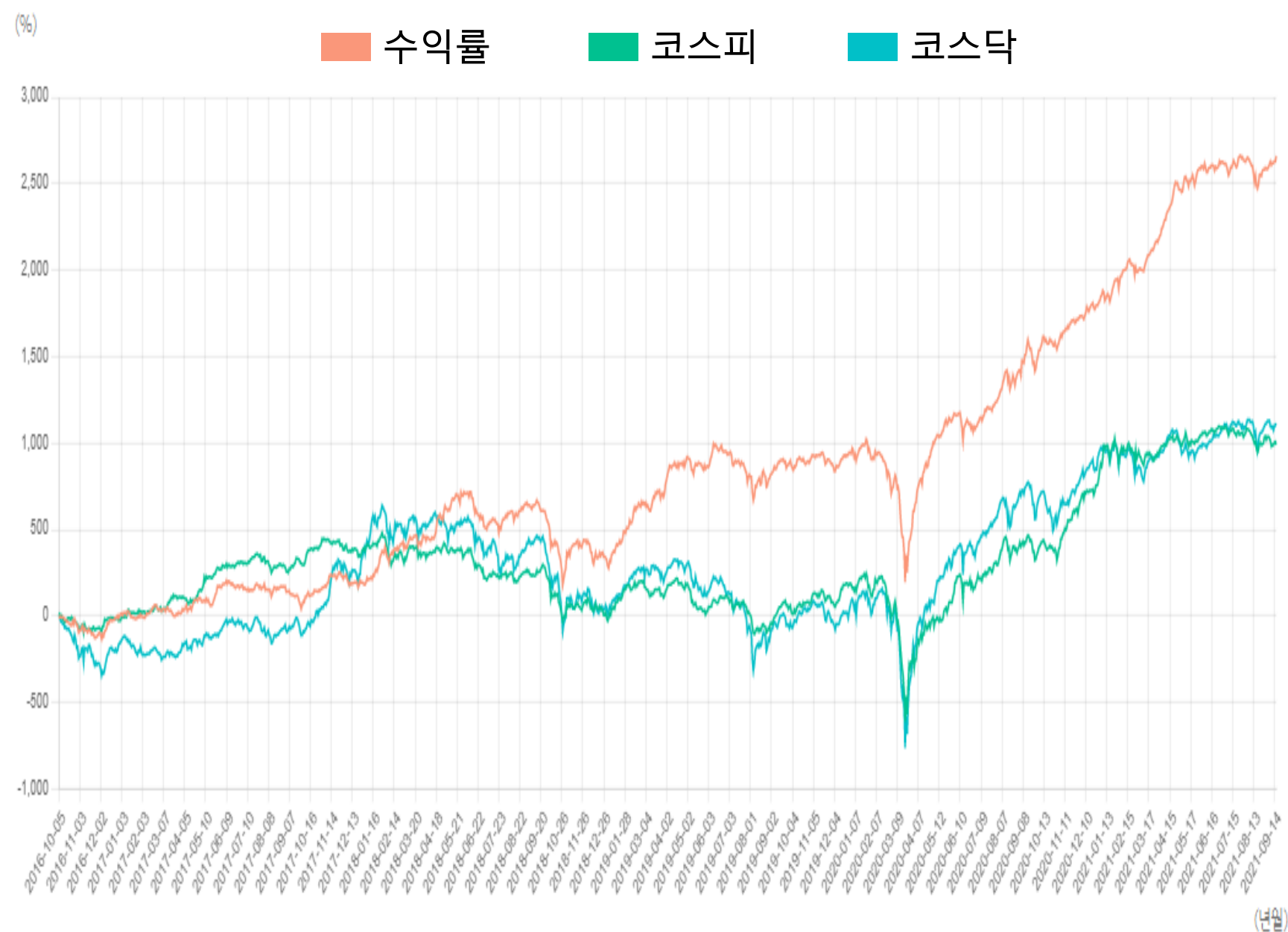
수익 계산

수익률 계산 (일, 누적, 상품별)

6561 선물옵션거래내역						
거래내역 일일정산 당일결제차금 대응증권잔고 옵션권리행사배정 예약주문 인수도잔고 외화잔고현황						
계좌번호 1234-5678-****		종목명	비밀번호	*****	01 전체	02 2012/02/08 ~ 2012/06/21
		03 조회건수	20			
거래일자	매매구분	종목코드	수량	거래금액	수수료	미수변제
04 적요명	거래순번	종목명	단가	05 정산금액	제세금	예수금잔고
2012/02/08	매도	301G2265	350	185,500,000	92,750	0
매도	1	K200 P02 265.0	5.30	185,500,000	0	327,153,952
2012/02/08	매도	101G3	40	5,218,000,000	0	0
당일차금	2	K200 12년 3월물	260.90	-4,000,000	0	323,153,952
2012/02/08	매도	101G3	32	4,176,000,000	187,880	0
당일차금	3	K200 12년 3월물	261.00	-1,600,000	0	321,366,072
2012/02/08	매수	101G3	4	521,500,000	0	0
당일차금	4	K200 12년 3월물	260.75	700,000	0	322,066,072
2012/02/08	매수	101G3	28	3,651,200,000	0	0
당일차금	5	K200 12년 3월물	260.80	4,200,000	0	326,266,072
2012/02/08	매수	101G3	12	1,565,100,000	0	0
당일차금	6	K200 12년 3월물	260.85	1,500,000	0	327,766,072
2012/02/08	매수	101G3	28	3,652,600,000	187,800	0
당일차금	7	K200 12년 3월물	260.90	2,800,000	0	330,378,272
2012/02/08	매수	301G2265	10	4,700,000	0	0

# 자동매매 개요

## 도출 결과





# 데이터 처리 및 모델 구성 개요

---

01

## 증권 API 연동

- 증권 API 활용 자동매매 봇 구현

02

## 모델 성능 향상

- 모델별 비교 후 보팅

03

## 나스닥, 항생지수, 코스피200 연동

- 나스닥 종가, 항생지수 연동으로 자동매매 포지션 결정



# 데이터 처리 및 모델 구성 개요

## 데이터

코스피200 현재가



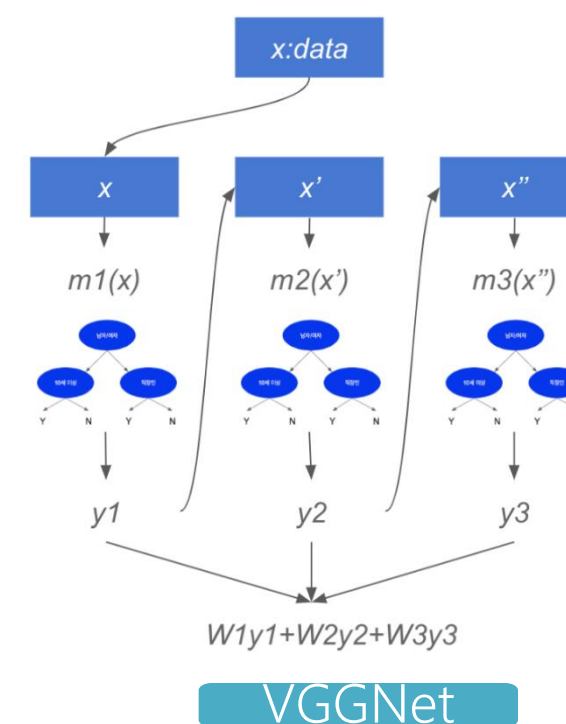
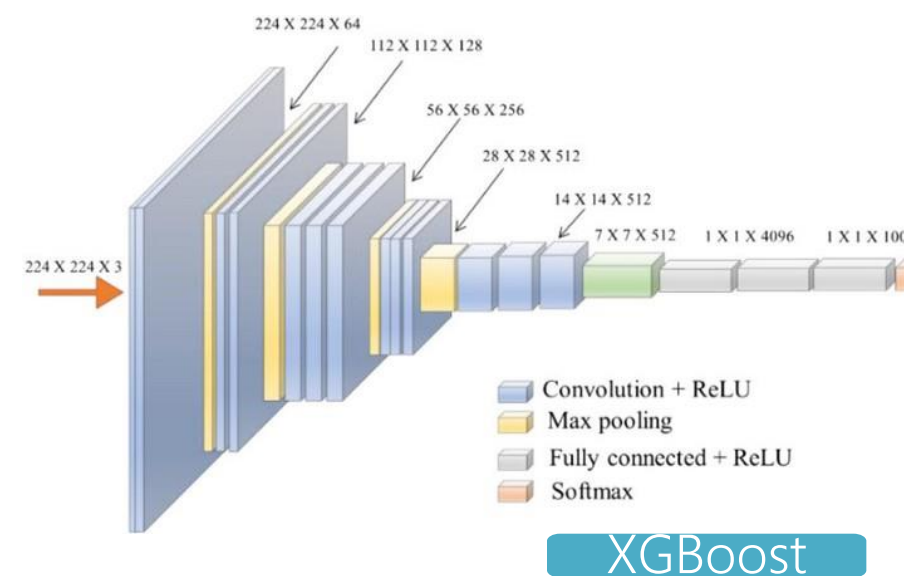
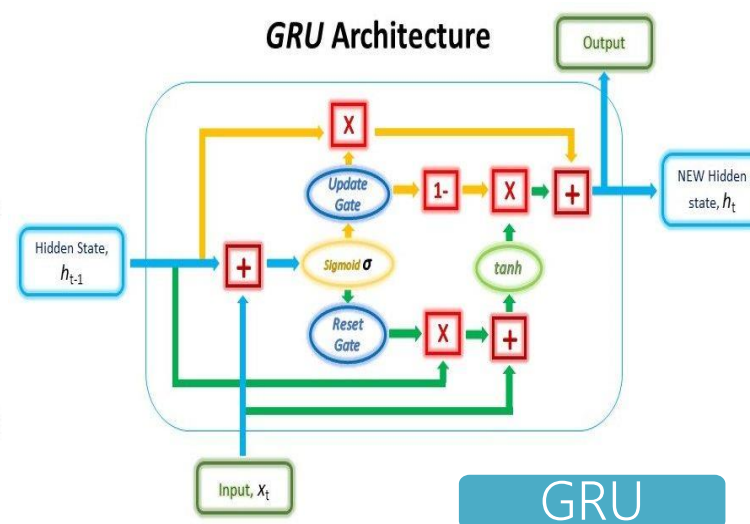
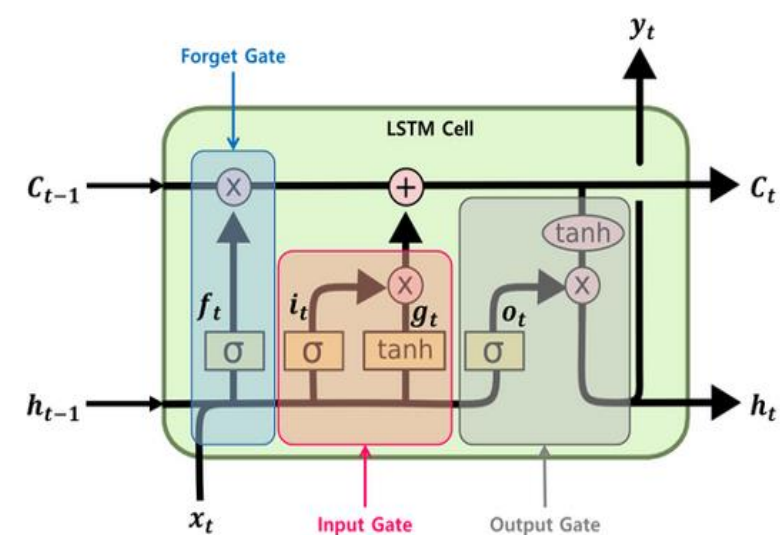
나스닥 전일 종가



항생지수



## 모델 구성





# 종합 흐름도

데이터



모델링



매도/매수

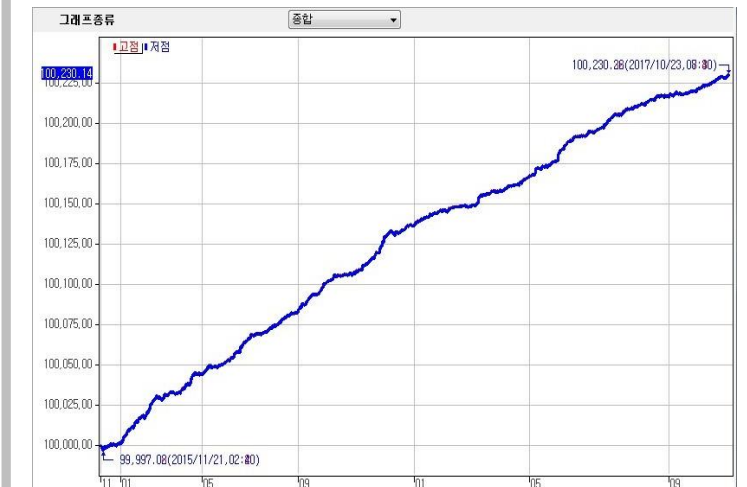
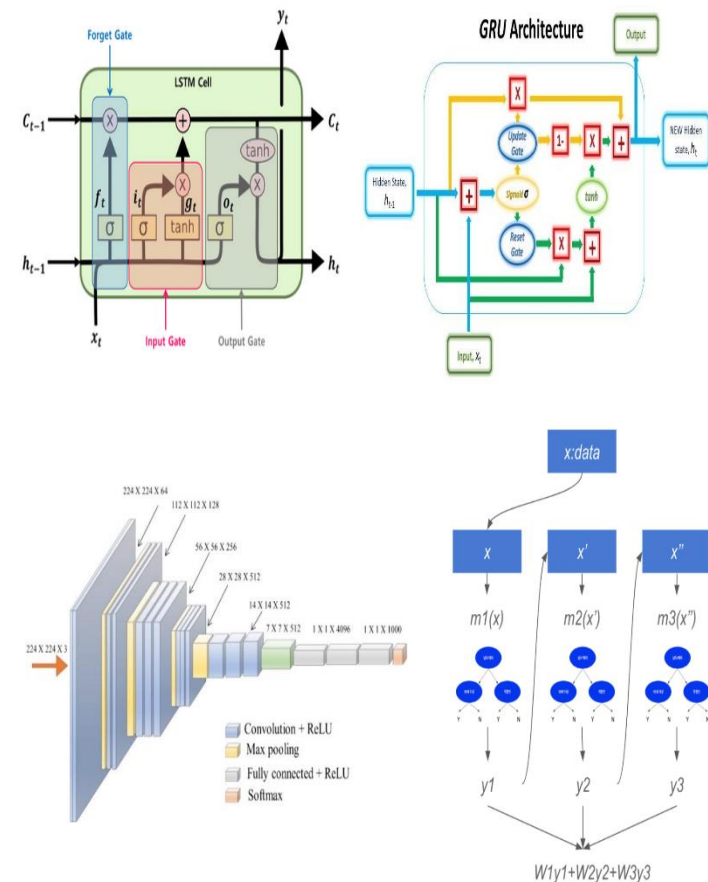


수익확인

Nasdaq



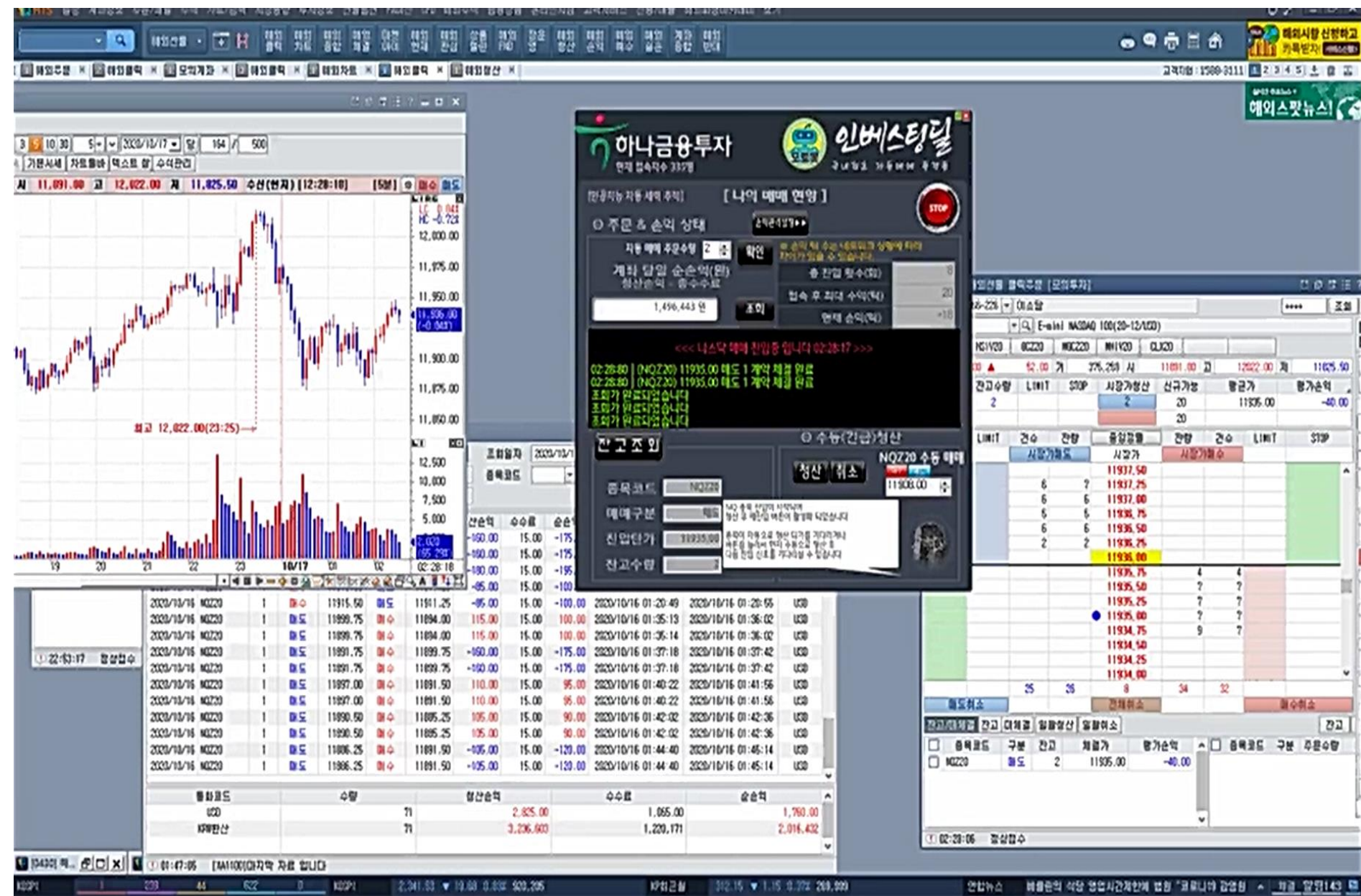
恒生指數  
HANG SENG INDEXES



데이터 기반 모델로 예측값 도출

예측값 + 매매알고리즘







# 프로젝트 타임테이블

CONTENTS	3월 1주	3월 2주	3월 3주	3월 4주	4월 1주	4월 2주	4월 3주	4월 4주	5월 1주	비고
프로젝트 방향설정										
모델선정										
데이터수집										
논문리뷰										
모델구성										
매매전략 검증										
테스트 및 개선										
최종점검										



# 적용기술

## 개발환경



## 개발도구





# 시연 영상

