

[실전 가이드] 청산 히트맵 기반 OKX 그리드 봇 매매 전략

1. 전략의 핵심 원리

청산(Liquidation)이 발생하는 지점에서는 대량의 강제 주문으로 인해 가격이 일시적으로 오버슈팅(과매도/과매수) 한 뒤, 제자리로 돌아오는 성질(Mean Reversion)이 있습니다. 이 전략은 그 '꼬리(Wick)'를 잡아내는 **역추세 박스권 매매**입니다.

*롱 청산 (Long Squeeze):** 가격 급락 → 패닉 셀 → **V자 반등** (하단 매수 기회)

*숏 청산 (Short Squeeze):** 가격 급등 → 강제 매수 → **급락 되돌림** (상단 매도 기회)

*대응:** 슬리피지가 심한 시장가 진입 대신, **지정가(Limit) 주문**을 미리 깔아두는 '그물 매매'가 필수적입니다.

2. OKX 그리드 봇(Grid Bot) 설정 가이드

일반 주문으로는 롱/숏 자동 스위칭이 불가능하므로, OKX의 **Futures Grid Bot**을 사용합니다.

A. 봇 진입 및 모드 선택

1. **메뉴:** Trade → Trading Bots → Grid Strategies → **Futures Grid**

2. **설정 방식:** **Manual** (수동 설정)

3. **방향(Direction):** **Neutral (중립)**

* **핵심:** 현재가를 기준으로 위쪽은 숏(공매도), 아래쪽은 롱(공매수)을 자동으로 수행하며 무한 스위칭합니다.

B. 파라미터 세부 설정 (예시: TAO/USDT)

1. **Price Range (가격 범위):** 청산 히트맵 데이터를 기반으로 설정

* **Lower (하한가):** 롱 청산 밀집 구간 하단 (예: 270 USDT)

* **Upper (상한가):** 숏 청산 밀집 구간 상단 (예: 294 USDT)

2. **Grid Quantity (그리드 개수):** 등차(Arithmetic) 방식

* **권장 개수:** 14 ~ 20개

* **목표 수익률:** **Profit margin/grid가 0.5% ~ 1.0%** 나오도록 개수 조절 (수수료 대비 효율 최적화)

3. **Leverage (레버리지):** **1x (1배수)**

* **이유:** 역추세 매매의 리스크(추세 이탈)를 방어하기 위해 저배율 필수. 청산가(Liq. Price)를 최대한 멀리 보내야 함.

C. 리스크 관리 (Stop Loss) - 필수!

박스권을 강하게 뚫고 나가는 '진짜 추세' 발생 시 강통을 방지하기 위함입니다.

* **Stop Loss:** **PnL (손익률) 기준 -3% ~ -5%** 설정

* 의미: 가격이 상/하한가를 뚫고 나가서 내 원금의 3% 이상 손실이 나면 기계적으로 봇을 종료하고 손절함.

3. 운영 및 시각화 (Visualization)

봇을 실행했는데 차트에 주문선이 안 보일 때의 해결책입니다.

1. **주문선 켜기:** 봇 메뉴의 점 3개(...) 또는 설정 아이콘 클릭 → **[Display order lines]** 클릭.

2. **확인:** 차트에 빨간색 선(매도 대기)과 초록색 선(매수 대기)이 그물처럼 펼쳐져 있는지 확인.

3. **수량 배분:** Arithmetic 모드는 모든 가격대에 동일한 수량을 배치합니다. (마틴게일 방식처럼 멀어질수록 수량을 늘리는 것은 추세 이탈 시 리스크가 너무 커서 추천하지 않음)

4. 트레이더 체크리스트 (요약)

☒ **진입 전:** 청산 히트맵을 확인하여 주요 지지/저항 라인을 업데이트했는가?

☒ **설정 시:** Neutral 모드와 1배수(1x) 레버리지를 확인했는가?

☒ **안전 장치:** Stop Loss(-3% 등)를 빼먹지 않고 입력했는가?

☒ **실행 후:** 'Display order lines'를 켜서 주문이 내 의도대로 깔렸는지 차트에서 확인했는가?