**@ 변수 및 용어** – 실제 의미와 다를 수 있음

**capital (순자산)** : 평가손익을 제외한 자산

- 업데이트 함수: **sell**

- 업데이트 시기: 확정손익 발생시

- 식: capital 🡨 capital - profit

**equity (총자산)**: 평가손익을 포함한 전체 자산

- 업데이트 함수: **write\_equitylog(날짜, 종가리스트)**

- 업데이트 시기: 매일

- 식: equity 🡨 capital + open\_profit

**real\_equity (실자산)**: 스탑가격 기준의 자산

- 업데이트 함수: **write\_equitylog(날짜, 종가리스트)**

- 업데이트 시기: 매일

- 식: real\_equity 🡨 capital + 확정예정손익

- 확정예정손익: 포지션\*(스탑가격 – 진입가격)\*랏수

**avail\_equity (가용자산)**: 유지 증거금을 제외한 총자산

- 업데이트 함수: **write\_equitylog(날짜, 종가리스트)**

- 업데이트 시기: 매일

- 식: equity – open\_margin

**open\_profit (평가손익)**

- 업데이트 함수: **open\_status(종가)**

- 업데이트 시기: 매일

- 식: 매일 종목별 (종가 – 진입가) 의 총합

**open\_margin (평가손익)**

- 업데이트 함수: **open\_status(종가)**

- 업데이트 시기: 매일

- 식: 매일 종목별 (유지 증거금 \* 잔여랏수) 의 총합

**portfolio\_heat**: 허용가능 포트폴리오 손실액

- portfolio\_heat\_ratio \* 순자산

- \_portfolio\_risk\_ratio: 허용가능 포트폴리오 손실비율 (순자산 대비)

**risk\_heat**: 허용가능 매매당 손실액

- return: \_risk\_capa \* 실자산

- \_risk\_capa: 허용가능 매매당 실자산 대비 손실비율

**portfolio\_risk**: 포트폴리오 리스크 금액

- 순자산 – 실자산

- 음수면 0

**risk**: 진행중인 매매의 리스크 금액

- 진입가 – 청산예정가격

- 업데이트 함수:

**stop\_price:** 청산예정가격

- 전략에 따라 계산 기준 다름. ex) ATR, 지지저항 등.

- 업데이트 함수: **stop\_rule()**

- 업데이트 기준: 전략에 따라 다름

손익: profit

매매당 위험: risk

포트폴리오 위험: portfolio\_risk

허용가능 포트 손실액: portfolio\_risk\_capa, ex) 순자산의 10%..

허용가능 매매 손실액: risk\_capacity, ex) 순자산의 2%

허용가능 매매 손실(틱): risk\_capa\_in\_tick

잔여계약수: lot

진입 계약수: entrylot

청산 계약수: exitlot

진입 주문: entry\_order

청산 주문: exit\_order

틱가치: tick\_value

**@ 매매 흐름도**

1. 진입신호 발생시

a) 위험(risk) 결정:

- 지지, ATR

b) 매매 여부 결정

if 위험 > 허용가능 손실액:

매매 안함

if 총 위험(total\_risk) + 매매당 위험 > 허용가능 손실액:

매매 안함

else:

매매 진입

c) 진입 계약수 결정

- 진입 계약수 = int(매매당 허용가능 최대 손실 / 매매당 위험)

d) 진입 주문

- 포지션, 계약수

e) 가용자산 수정: 현재 가용자산 – 진입계약수 \* 종목 증거금

f) 진입 매매 기록

2. 청산신호 발생시

a) 청산 계약수 결정: How?

b) 청산 주문

c) 청산 매매 기록

d) 자산 수정:

- 순자산 = 순자산 + 손익

- 가용자산 = 가용자산 + 청산계약수\*종목증거금

3. 매일 점검 사항

a) 평가손익 계산: 잔여계약수 \* (진입 가격 – 당일종가) \* 틱가치 / 틱단위

a) 총자산 수정: 총자산 = 순자산 + 평가손익

**@ 매매 평가**

1. 포트폴리오 평가

a)평가 항목

1) 총손익

2) bliss: IGCAR/MDD

3) MDD

4) profit factor

5) 승률

6) 최대수익

7) 최대손실

8) 종목평균 연 매매횟수

2. 종목별 평가

a) 평가 항목

1) 누적손익

2) 평균손익

3) 손익표준편차

4) 위험 대비 손익

5) 총매매횟수