

당일종가청산 관련 안내 도움말

(당일 증가 청산, 당일 청산, 당일 진입 금지)

본 도움말 문서는 Stage의 당일종가청산 및 당일청산, 당일진입금지 설정에 대한 내용을 담고 있습니다.

Stage 차트에서 매매전략을 적용한 후, [지표속성]의 설정을 살펴보면 다음과 같이 [매매신호] 항목에 [당일청산] 설정 부분이 있습니다.

DMI Strategy 속성 x

지표 매개변수
매매신호
진입/청산 설정
스케일
알람
종목 설정

10199000

비용
매매계약수
당일청산
손절매

당일청산

당일 증가 청산

당일 청산 오전 10:06:59

당일 진입 금지 오전 10:06:59

※ 설정된 시간은 시세 시간 기준이며 실매매 시 다양한 경우의 수가 존재하므로 공지사항의 관련내용을 반드시 숙지 후 사용하시길 바랍니다.

확인
취소

1. 당일 종가 청산

당일 종가를 기준으로 보유 포지션을 청산합니다. 이 기능은 전략편집기의 ExitOnClose 함수와 동일한 것으로 당일의 일봉 종가에 해당하는 가격으로 보유 포지션을 청산합니다. 당일 종가 청산 기능은 시뮬레이션(백테스트) 목적으로 사용할 수 있습니다.

실시간의 상황에서는 당일 종가를 파악하는 것이 근본적으로 불가능한 부분이 있습니다. 예를 들어 국내 코스피200 선물의 경우 보통 당일 15:15에 장종료가 일어나며 그때의 가격이 당일의 종가가 됩니다. 하지만 15:15의 종가시세를 확인하고 난 후 현실적으로 주문을 내는 것이 불가능합니다.

그렇기 때문에 실시간의 상황에서는 [당일 종가 청산] 기능보다는 바로 아래에 말씀드릴 [당일 청산] 기능을 사용하여야 합니다.

또한 과거시세 차트에서 당일종가청산이 적용되었을 경우의 성과분석 및 시뮬레이션 결과는 실제 시장에서 이러한 상황이 있기 때문에 실제 결과와 차이가 생길 수도 있게 됩니다. 이러한 부분을 유의하시길 바랍니다.

2. 당일 청산

당일 청산은 특정 시점을 기준으로 차트 상의 포지션을 청산합니다. 매매전략에 의해 장중 포지션을 보유한 상태라면 지정한 시각에 해당 포지션에 반대되는 청산 신호를 발생시킵니다.

만약 코스피200선물의 경우 장종료 전 포지션 청산을 하고자 할 경우에는 15:05~15:15까지 동시호가 시간임을 감안하여 당일 청산을 14:50 정도로 맞춰 놓는 것이 좋습니다.

또한 만기일에는 장종료가 좀더 일찍 이루어지기 때문에 이러한 부분을 감안하여 14:30 등으로 설정하는 것이 좋습니다.

* 주의사항1

당일 청산을 활성화하여도 포지션 종료 후에 매매전략의 새로운 진입 신호는 그대로 발생할 수 있습니다. 포지션 청산 후에 매매도 완전히 정지 시키고자 할 경우(신규 진입 금지) 아래에 설명되는 [당일 진입 금

지] 설정을 반드시 함께 사용하여야 합니다.

*** 주의사항2**

Stage의 내부연산은 실시간 시세가 갱신될 때 마다 이루어집니다. 새로운 틱시세가 들어올 때마다 내부적으로 연산이 일어나게 되며, 이것은 Buy, Sell 신규주문과 [당일 청산] 주문 모두 마찬가지입니다. 그렇기 때문에 간혹 유동성이 적은 종목을 매매할 경우, 시세가 들어오지 않아 주문이 지연되는 것처럼 보일 수 있습니다.

옵션 내가격 종목이나 국고채, 개별주식선물의 일부 종목의 경우 거래가 일어나지 않는 경우가 있습니다. 만약 14:00 ~ 14:20 까지 20분간 거래가 일어나지 않았다면 Stage에서는 시세가 수신되지 않기 때문에 새로운 연산 및 동작을 하는 것이 불가능합니다. 이는 Stage뿐 아니라 타 시스템트레이딩 플랫폼에서도 발생하는 현상입니다. 이로 인해 만약 [당일청산] 시간을 14:10과 같이 설정하였을 경우, 14:10분에 당일청산 신호가 발생하는 것이 아니라 시세가 멈춘 후 시세가 들어오기 시작하는 시간인 20분에 신호가 발생하여 청산이 이루어지게 됩니다. 이는 시스템트레이딩 플랫폼의 내부연산 및 신호처리는 시세가 들어올 때 마다 이루어지는 것이기 때문입니다.

그러므로 시스템트레이딩 플랫폼을 원활히 사용하기 위해서는 적절한 유동성을 갖춘 종목을 매매하는 것이 좋습니다.

3. 당일 진입 금지

특정 시점을 기준으로 신호를 발생시키지 않습니다. 당일 청산 옵션과 함께 사용하는 것이 가능합니다. 동시에 사용하여 특정 시점 이후로 포지션 청산과 매매 중지를 할 수 있으며, 진입 금지만 사용하여 신규주문이 발생하는 것을 중지시킬 수도 있습니다.