CMJ QUANT TRADER

씨앰제이 통합 퀀트 투자 · 시스템트레이딩 플랫폼 | 2026.11.17

종목 발굴부터 실전매매와 포트폴리오 분석까지

KOSPI · KOSDAQ 전체 일반주식 / 키움증권 REST API / Windows PC

본 자료는 개발 기획안이며 실제 구현 · 검증 완료를 의미하지 않습니다 .

01 프로젝트 비전

기존 분할매매 도구를 넘어 데이터 기반 투자 의사결정 플랫폼으로 확장

발굴

전체 상장 일반주식에서 재무적으로 건전한 후보 탐색

평가

기술적 추세 · 상대강도 · 유동성으로 우선순위 산출

검증

백테스트와 모의투자로 전략의 성과 · 위험 확인

실행 · 관리

차수별 자동매매와 보유종목 정량 · 정성 분석

02 사용자 투자 흐름

추천 결과가 실제 투자 성과 분석까지 연결되는 폐쇄 루프

01
데이터 수집

02
재무 위험 필터

03
기술 점수 산출

04
추천종목 TOP N

05
백테스트

06
모의투자

07
실전 분할매매

08
포트폴리오 분석

03 분석 대상과 데이터 공급

시장 데이터와 공시 데이터를 구분 수집하고 원천 · 기준일을 기록

분석 유니버스

KOSPI·KOSDAQ 일반주식 전체 . 우선주 ·ETF·ETN·SPAC 별도 분류

KRX / 키움

종목 목록 , 일별 OHLCV, 거래대금 , 수급 , 장중 시세

OpenDART

공시일 기준 재무제표 , 감사의견 , 자본잠식 , 기업 이벤트

데이터 품질

누락 · 중복 · 수정주가 · 기업행동 · 상장폐지 이력 점검

04 1 차 재무 평가 엔진

위험 필터 통과 후 업종별 상대평가 및 절대 위험 기준 적용

위험 필터

관리종목 · 거래정지 · 중대한 감사의견 문제 · 완전자본잠식 제외

안정성 30 점

부채비율 · 유동비율 · 이자보상배율

수익성 25 점 / 현금흐름 20 점

ROE·ROIC· 영업이익률 / 영업현금흐름 ·FCF

성장성 15 점 / 가치 10 점

매출 · 이익 성장 / PER·PBR·EV/EBITDA

※ 점수와 가중치는 초기 설계 가설이며 검증 전 확정 기준이 아닙니다 .

05 2 차 기술 평가 엔진

재무 적격 종목에 대해 매매 적합성과 위험을 분리 평가

추세 30 점

20·60·120·200 일 이동평균선 , 기울기 , 배열

상대강도 25 점

1·3·6 개월 시장 · 업종 대비 초과수익률

거래대금 20 점

20 일 평균 거래대금 , 최근 거래 증가

모멘텀 15 점 / 위험 10 점

RSI·52 주 고점 근접도 / ATR· 변동성 ·MDD

분할매매형과 추세추종형의 추천 등급을 별도로 제공합니다 .

06 추천종목 엔진

점수뿐 아니라 선정 근거와 제외 사유를 함께 제시

CMJ 종합점수 = 재무점수 × 40% + 기술점수 × 60%

추천 출력

종목 · 업종 · 점수 · 추천 유형 · 기준일 · 상위 선정 사유

예외 처리

위험 필터 탈락 종목 제외 , 데이터 결측은 평가 보류

설명 가능성

지표별 원점수 · 가중치 · 데이터 출처 · 계산 버전 기록

검증 원칙

점수의 예측력 · 시장별 성과 · 가중치 민감도 백테스트

07 분할매수 · 분할매도 전략

매수 차수마다 체결원가 · 수량 · 목표매도가를 독립 관리

매수 규칙

최초 진입 조건 , 직전 체결가 대비 하락률 , 최대 차수

매도 규칙

차수별 목표수익률 , 일부 매도 , 재진입 조건

자금 통제

종목별 한도 , 계좌 총 노출 , 추가매수 중단 조건

체결 상태

주문 접수 · 부분체결 · 미체결 · 취소 · 재시작 복구

전략 파라미터 예시 : 5 차 분할 / -5% 추가매수 / +4% 차수별 목표매도 (검증 전 가설)

08 백테스트 설계

단순 수익률보다 재현성 · 편향 통제 · 위험지표를 우선

테스트 전략

단순 보유 / 고정간격 분할 / ATR 기반 / 추세 중단형

성과지표

CAGR·MDD·Sharpe·Sortino·Calmar· 자금사용률

현실적 체결

매매일별 수수료 · 세금 · 슬리피지 , 호가단위 · 거래정지

편향 방지

공시일 이후 재무정보 사용 , 과거 상장폐지 종목 포함

2008 년 등 장기 위기 국면 테스트는 별도 역사 데이터 확보 여부를 확인해야 합니다 .

09 모의투자 → 실전매매

주문 엔진은 동일하게 유지하고 실행 환경만 단계적으로 전환

1. 오프라인 시뮬레이션

과거 데이터 · 가상 체결로 전략 로직 검증

2. 실시간 가상매매

시세 연동 , 주문 대기 · 체결 · 잔고 관리 시험

3. 키움 모의환경

공식 지원 범위 내 주문 · 취소 · 체결 검증

4. 실계좌 소액 운영

위험 한도 · 중복 주문 방지 · 긴급 중지 검증

기본 설정 : 실주문 비활성화 . 인증키는 환경변수 · 보안 저장소에 보관 .

10 포트폴리오 대시보드

기존 CMJ Stock Manager 기능을 소스 확인 후 재사용 · 통합

계좌 · 성과

예수금 , 평가금 , 실현 · 미실현손익 , 전략별 성과

리스크

종목 · 업종 집중도 , MDD, 총 노출 , 차수별 미실현손실

보유종목 정량분석

실적 · 밸류에이션 · 차트 · 상대강도 · 수급

보유종목 정성분석

사업 경쟁력 · 지속가능성 · 이슈 ·AI 리서치 보고서

11 시스템 아키텍처

모듈 간 결합도를 낮춰 추천 규칙과 주문 엔진을 독립적으로 개선

UI | PySide6

추천 · 전략 · 백테스트 · 모의투자 · 포트폴리오 화면

Data | SQLite

종목 · 시세 · 공시 · 점수 · 거래 · 감사 로그 저장

Analytics | Python

pandas·NumPy, 재무 / 기술 점수 및 백테스트

Broker | 키움 REST

조회 · 시세 · 체결 이벤트 , 주문 게이트웨이

보안 : 인증정보 분리 / 주문 이벤트 기록 / API 제한 관리 / 장애 복구

12 단계별 개발 로드맵

단계별 검수 완료 후 다음 단계로 진입

Phase 1 | 1~2 주

전체 종목 · 주가 ·DART 수집 , DB· 품질 검증

Phase 2 | 2~3 주

재무 / 기술 점수 , 추천 TOP20, 선정 근거

Phase 3 | 3~4 주

차수별 전략 · 백테스트 · 성과 비교

Phase 4–5 | 4~7 주

모의투자 · 대시보드 → 제한적 실전매매

총 10~16 주 : 개발 일정의 초기 추정치이며 데이터 권한 · 검증 범위에 따라 변동

13 Phase 1 착수 및 검수 기준

첫 산출물 : 실행 가능한 Windows 데이터 수집 MVP

구현 범위

종목 마스터 / 일별 시세 / OpenDART 재무 / SQLite / 수집 로그

검수 지표

수집 성공 · 실패 건수 , 중복 · 결측 현황 , 기준일 및 데이터 출처

안전성

실주문 코드 비활성 , API 키 비노출 , 실패 시 데이터 보존

다음 단계 진입

원천 데이터 대조 후 재무 · 기술 스크리너 개발

개발 상태 : 기획 및 착수 단계 — 실제 구현 · 운영 결과는 별도 검수 필요