

# V5 장중 자동매매 전략 비교 보고서

작성일: 2026년 1월 29일  
분석 기간: 2026년 1월 27일 ~ 29일 (3일)  
데이터: 장중 스코어 CSV 111개 파일, 84,410 레코드

## 1. 비교 대상

구분	현행 전략	신규 전략
스코어 버전	V5	V5
매수 기준	65점 이상	65점 이상
매도 기준	40점 미만	50점 미만
추가 조건	15% 이상 상승 제외	15% 이상 상승 제외

## 2. 시뮬레이션 결과 비교

### 2.1 손익 비교

항목	65점/40점 (현행)	65점/50점 (신규)	차이
실현 손익	+19,285원	+238,203원	+218,918원
미실현 손익	+300,271원	+120,197원	-180,074원
총 손익	+319,556원	+358,400원	+38,844원
수익률	+10.65%	+11.95%	+1.29%p

### 2.2 거래 통계

항목	65점/40점 (현행)	65점/50점 (신규)
매수 횟수	45회	85회
매도 횟수	11회	52회
승리 거래	6회	35회
손실 거래	5회	17회
승률	54.5%	67.3%
현재 보유	34개	33개

### 3. 전략 특성 분석

#### 3.1 현행 전략 (65점/40점)

특징:

- 매도 기준이 낮아(40점) 보유 기간이 길어짐
- 실현 손익이 적고 미실현 손익이 큼
- 거래 빈도가 낮음 (매도 11회)
- 큰 수익 종목을 오래 보유하여 수익 극대화 가능

장점:

- 상승 추세 종목의 수익을 최대한 확보
- 거래 비용 절감 (거래 횟수 적음)

단점:

- 손실 종목도 오래 보유하여 기회비용 발생
- 미실현 이익이 실현되지 않을 위험

#### 3.2 신규 전략 (65점/50점)

특징:

- 매도 기준이 높아(50점) 빠른 회전
- 실현 손익이 크고 미실현 손익이 작음
- 거래 빈도가 높음 (매도 52회)
- 수익 실현이 빨라 자금 회전을 높임

장점:

- 높은 승률 (67.3%)
- 손실 종목 빠른 정리
- 수익 실현으로 확정 이익 확보

단점:

- 상승 추세 종목 조기 매도 가능성
- 거래 비용 증가

### 4. 보유 종목 비교

#### 4.1 현행 전략 (65점/40점) - 상위 5개

종목	손익	수익률
한컴위드	+29,100원	+29.8%
나노팀	+27,170원	+28.7%
인텔리안테크	+27,000원	+34.5%

종목	손익	수익률
삼화전기	+20,200원	+24.4%
오킨스전자	+17,440원	+19.6%

## 4.2 신규 전략 (65점/50점) - 상위 5개

종목	손익	수익률
테스	+17,500원	+32.1%
피에스케이	+14,700원	+15.6%
오스코텍	+13,700원	+14.1%
스피어	+13,000원	+14.4%
라온로보틱스	+10,450원	+12.5%

## 5. 결론 및 권장

### 5.1 수치 비교 요약

지표	현행 (65/40)	신규 (65/50)	우위
총 손익	+319,556원	+358,400원	신규
수익률	+10.65%	+11.95%	신규
승률	54.5%	67.3%	신규
자금 회전	낮음	높음	신규
미실현 위험	높음	낮음	신규

### 5.2 권장 사항

65점/50점 (신규) 전략 채택 권장

이유:

1. 총 손익 +38,844원 우위 (3일 기준)
2. 승률 67.3% - 현행 대비 12.8%p 높음
3. 실현 이익 비중 높음 - 시장 변동성에 강함
4. 자금 회전을 개선 - 더 많은 매매 기회 활용

### 5.3 주의사항

- 3일간의 백테스트 결과이므로 장기 검증 필요
- 시장 상황(상승장/하락장)에 따라 결과 다를 수 있음

- 거래 비용(수수료, 세금) 고려 시 차이 축소 가능

6. 현재 적용 설정

User	이름	모드	매수	매도
2	김형철	semi	65점	50점
7	모의투자	auto	65점	50점
17	조은미	auto	65점	50점

2026년 1월 30일부터 V5 65점/50점 전략 적용

보고서 작성: Claude Code