

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 회전율 높음

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
한컴워드	+29,100원	+29.8%
나노팀	+27,170원	+28.7%
인텔리안테크	+27,000원	+34.5%

종목	손익	수익률
삼화전기	+20,200원	+24.4%
오키스전자	+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:

- 총 손익 +38,844원 우위 (3일 기준)
- 승률 67.3% - 현행 대비 12.8% 높음
- 실현 이익 비중 높음 - 시장 변동성에 강함
- 자금 회전율 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