

# 장중 자동매매 전략 비교 보고서

V2 65점/40점 (현행) vs V5 65점/50점 (신규)

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	V2 (추세 추종)	V5 (장대양봉)
매수 기준	65점 이상	65점 이상
매도 기준	40점 미만	50점 미만
추가 조건	15% 이상 상승 제외	15% 이상 상승 제외

### 스코어 버전 특성

버전	전략명	핵심 지표
V2	추세 추종 강화	역배열 과락, 20일선 기울기
V5	장대양봉	눌림목, BB수축, 이평선 밀집, OBV 다이버전스

## 2. 시뮬레이션 결과 비교

### 2.1 손익 비교

항목	V2 65/40 (현행)	V5 65/50 (신규)	차이
실현 손익	+53,965원	+238,203원	+184,238원
미실현 손익	+115,568원	+120,197원	+4,629원
총 손익	+169,533원	+358,400원	+188,867원
수익률	+5.65%	+11.95%	+6.30%p

### 2.2 거래 통계

항목	V2 65/40 (현행)	V5 65/50 (신규)
매수 횟수	70회	85회
매도 횟수	36회	52회
승리 거래	19회	35회
손실 거래	17회	17회

승률	52.8%	67.3%
현재 보유	34개	33개

### 3. 핵심 차이점 분석

#### 3.1 수익률 차이 (+6.30%p)

요인	V2 (현행)	V5 (신규)	영향
스코어 정확도	52.8% 승률	67.3% 승률	V5 우위
매도 타이밍	40점까지 보유	50점에서 매도	V5 우위
실현 이익	+53,965원	+238,203원	V5 우위

#### 3.2 V5 우위 이유

1. 장대양봉 패턴이 단기 상승에 더 적합 - V5는 단기 모멘텀 포착에 유리
2. 매도 기준 50점이 적절한 청산 타이밍 - 40점까지 하락 시 수익 상당 부분 반납
3. 높은 승률 (67.3%) - 손실 거래 동일(17회)하지만 승리 거래 2배(19회→35회)

### 4. 보유 종목 비교 (상위 5개)

#### V2 65/40 (현행)

종목	손익	수익률
아주IB투자	+27,160원	+27.4%
원익IPS	+23,200원	+26.4%
RFHIC	+17,400원	+21.4%
대한광통신	+15,450원	+15.5%
리노공업	+12,400원	+15.6%

#### V5 65/50 (신규)

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

### 5.1 수치 요약

지표	V2 65/40	V5 65/50	승자
총 손익	+169,533원	+358,400원	V5
수익률	+5.65%	+11.95%	V5
승률	52.8%	67.3%	V5
실현 비중	32%	66%	V5

### 5.2 최종 권장: V5 65점/50점 전략 채택

- 3일간 +188,867원 (+6.30%p) 추가 수익
- 승률 67.3% (현행 대비 +14.5%p)
- 실현 이익 비중 높아 안정적

## 6. 현재 적용 설정

User	이름	모드	스코어	매수	매도
2	김형철	semi	V5	65점	50점
7	모의투자	auto	V5	65점	50점
17	조은미	auto	V5	65점	50점

2026년 1월 30일부터 V5 65점/50점 전략 적용

보고서 작성: Claude Code