

장중 자동매매 전략 최적화 시뮬레이션 보고서

작성일: 2026년 1월 29일

분석 기간: 2026년 1월 27일 ~ 29일 (3일)

데이터: 장중 스코어 CSV 111개 파일, 84,410 레코드

1. 개요

1.1 분석 목적

- 기존 V2 기반 자동매매 전략의 수익률 개선
- V1~V10 스코어 버전별 최적 매수/매도 기준 도출
- 손절 및 물타기 전략 효과 검증

1.2 시뮬레이션 조건

항목	값
총 투자 한도	300만원
종목당 투자금	10만원
매수 제외 조건	당일 15% 이상 상승 종목
분석 시간대	09:03 ~ 15:43 (10분 간격)

2. 기존 전략 분석

2.1 기존 설정 (V2 75점/60점)

항목	결과
투자금액	1,584,801원
총 손익	+1,843원
수익률	+0.12%
거래 횟수	17회

문제점: 매수 기준이 너무 높아(75점) 매수 기회가 적고, 매도 기준(60점)도 높아 조기 매도 발생

3. V2 최적화 결과

3.1 일별 최적 조합

날짜	최적 매수	최적 매도	수익률	손익
1/28 (화)	65점	45점	+1.67%	+49,958원
1/29 (수)	65점	55점	+4.48%	+134,364원
3일 전체	60점	55점	+7.98%	+239,378원

3.2 V2 매수/매도 기준별 성과 (3일 전체)

매수	매도	투자금액	손익	수익률	거래수
60점	55점	290만원	+239,378원	+7.98%	374회
65점	50점	284만원	+226,423원	+7.55%	210회
60점	45점	300만원	+216,804원	+7.23%	160회
65점	55점	247만원	+201,778원	+6.73%	293회
70점	50점	251만원	+114,869원	+3.83%	131회

결론: V2 기준 60~65점 매수, 50~55점 매도가 최적

4. 전체 버전(V1~V10) 비교 분석

4.1 버전별 최적 조합 및 성과

순위	버전	전략 특성	매수	매도	수익률	손익
1	V5	장대양봉, 눌림목, BB수축	65점	50점	+12.97%	+388,952원
2	V1	종합 기술적 분석	70점	40점	+12.74%	+382,254원
3	V4	Hybrid Sniper	50점	40점	+10.22%	+306,641원
4	V2	추세 추종	60점	35점	+8.05%	+241,500원
5	V9	갭상승 확률 (ML)	50%	30%	+6.97%	+209,100원
6	V3.5	사일런트 바이어	50점	40점	+3.93%	+117,900원
7	V10	Leader-Follower	50점	35점	+1.81%	+54,300원
8	V7	Trend Momentum	50점	35점	+1.58%	+47,400원
9	V6	Swing Predictor	50점	35점	+1.19%	+35,700원
10	V8	Contrarian Bounce	55점	35점	+0.00%	+0원

4.2 상위 10개 조합 (버전 무관)

순위	버전	매수	매도	손익	수익률
1	V5	65점	50점	+388,952원	+12.97%
2	V1	70점	40점	+382,254원	+12.74%
3	V5	55점	45점	+376,544원	+12.55%
4	V1	75점	45점	+373,195원	+12.44%
5	V5	65점	45점	+369,078원	+12.30%
6	V1	65점	40점	+368,236원	+12.27%
7	V1	65점	45점	+360,971원	+12.03%
8	V1	75점	40점	+360,015원	+12.00%
9	V1	60점	45점	+347,190원	+11.57%
10	V5	60점	50점	+346,160원	+11.54%

5. V5 스코어 분석

5.1 V5 점수 분포

구간	개수	비율
0점	310개	0.4%
1~30점	27,903개	33.0%
31~50점	39,453개	46.8%
51~65점	14,514개	17.2%
66점 이상	2,230개	2.6%

- 최저: 0점 / 최고: 89점 / 평균: 36.9점 / 중앙값: 35점
- 65점 이상은 상위 약 2.6%에 해당

5.2 V5 전략 특성

V5(장대양봉 전략)은 다음 패턴을 감지:

- 장대양봉 출현
- 눌림목 패턴
- 볼린저밴드 수축
- 이동평균선 밀집
- OBV 다이버전스

6. 손절/물타기 전략 검증

6.1 전략 조건

항목	조건
매수	$V5 \geq 65$ 점, 등락률 $< 15\%$
매도	$V5 < 50$ 점
손절	-5% 이하 & $V5 < 60$ 점
물타기	-5% 이하 & $V5 \geq 60$ 점 (최초투자금의 30%, 최대 3회)

6.2 결과

항목	값
일반 매도	47회
손절 매도	5회
물타기 매수	1회
실현 손익	+208,743원
미실현 손익	+121,507원
총 손익	+330,250원 (+11.01%)

6.3 손절 내역

시간	종목코드	손실	손실률
1/28 09:13	432470	-7,260원	-7.4%
1/29 09:08	052710	-5,130원	-5.4%
1/29 09:33	300080	-7,000원	-8.0%
1/29 09:33	102120	-4,900원	-5.3%
1/29 09:33	103590	-3,600원	-5.5%

총 손절 손실: -27,890원

6.4 손절/물타기 유무 비교

전략	수익률	손익	비고
V5 65/50 (손절 없음)	+12.97%	+388,952원	최대 수익

전략	수익률	손익	비고
V5 65/50 + 손절/물타기	+11.01%	+330,250원	리스크 관리

분석: 손절로 인해 수익률이 약 2%p 감소하나, 대형 손실 방지 효과 있음

7. 결론 및 권장 사항

7.1 최적 전략 요약

우선순위	스코어	매수 기준	매도 기준	예상 수익률
1순위	V5	65점	50점	+12~13%
2순위	V1	70점	40점	+12~13%
3순위	V4	50점	40점	+10%
(기존)	V2	75점	60점	+0.1%

7.2 권장 설정 변경

[]

- : V2
- : 75
- : 60

[]

- : V5
- : 65
- : 50
- : 15%
- : -5% & V5 < 60

7.3 기대 효과

항목	기존 (V2 75/60)	권장 (V5 65/50)	개선율
3일 수익률	+0.12%	+12.97%	108배
3일 손익	+1,843원	+388,952원	211배

7.4 주의사항

1. 백테스트 한계: 3일간의 데이터로 검증된 결과이므로, 장기간 검증 필요
2. 시장 상황 의존: 상승장/하락장에 따라 성과 차이 발생 가능
3. 슬리피지 미반영: 실제 거래 시 체결가 차이로 수익률 감소 가능
4. 장 초반 노이즈: 09:03~09:23 구간은 스코어 기록만 하고 매매 제외 권장

8. 향후 과제

1. 장기 백테스트: 1개월 이상 데이터로 전략 안정성 검증
2. 복합 스코어: V5 + V1 조합 등 멀티 스코어 전략 연구
3. 동적 기준선: 시장 변동성에 따른 매수/매도 기준 자동 조정
4. 섹터별 분석: 업종별 최적 스코어 버전 및 기준 도출

보고서 작성: Claude Code

검토 필요: 실제 운영 전 추가 검증 권장