

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

- 장대양봉 패턴이 단기 상승에 더 적합 - V5는 단기 모멘텀 포착에 유리
- 매도 기준 50점이 적절한 청산 타이밍 - 40점까지 하락 시 수익 상당 부분 반납
- 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%
월익IPS	+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 이익 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