


TQQQ 이동평균선 매매법 최적화 5편(QQQ 이평선 사용)

2024.09.09 03:03

 eulb 조회 수 58789 추천 수 58 댓글 48

https://www.fmkorea.com/7453855298


복사

사용한 툴: backtrading.py

아기티큐님 200일선 매매법: <https://www.fmkorea.com/7325015916>
최적화 1편: <https://www.fmkorea.com/7354894334>
최적화 2편(수수료): <https://www.fmkorea.com/7398740367>
최적화 3편(세금): <https://www.fmkorea.com/7408058418>
최적화 4편(절세 계좌): <https://www.fmkorea.com/7423450562>

 SoftSoap 2024.08.31 20:55

혹시 tqqq에 qqqi평선 신호 사용해보셨는지 궁금해요
tq는 tq신호 쓰는게 베스트인가요?

 폴딩스 3 시간 전

200일 매도 후 글 정독해서 잘 읽었습니다. 저도 3.229로 하려고 하는데, 어떤 유희 보니까 티큐 200일보다 티큐를 qqq200일로 기준을 잡던데, 전에 글 큐큐 3.161을 티큐에 적용하면 어떨까요??

이번에는 위 두분이 말씀해주신대로 QQQ 이평선 신호를 써봤습니다.
좋은 아이디어 제공해주신 두분께 감사인사 드립니다.

결론부터 말씀드리면 QQQ 신호(3, 161)이 제일 낫습니다.

예전에 엑셀로 QQQ 1,200으로 해봤을때는 TQQQ 1,200보다 결과가 안 좋게 나와서 그냥 넘어갔었는데, 확실히 QQQ 신호가 훨씬 더 우수하네요.

	TQQQ 직투 22배 거치식	QLD ISA 9.9배 SMA(TO 신호 3,219)	QLD ISA 9.9배 SMA(QLD 신호 3,196)	QLD ISA 9.9배 SMA/QQQ 신호 3,161	TQQQ 직투 22배 SMA(TQ 신호 3,229)	TQQQ 직투 22배 SMA(QLD 신호 3,196)	TQQQ 직투 22배 SMA/QQQ 신호 3,161
Start	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00
End	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00
Duration	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00
Exposure Time [%]	99.956188	68.017525	70.33954	71.872946	68.280394	70.33954	71.872946
Equity Final [\$]	493445645.5	289834683.4	352419859.3	418425591.6	573690863.9	702495315	764288752.5
Equity Peak [\$]	922977217.4	436774050	525187876.5	552368478.3	837149261.2	1210243024	1269719658
Return [%]	483.42844534	2798.346934	3424.198593	4084.235916	8636.908639	6924.95315	7542.887525
Buy & Hold Return [%]	6100.585441	3749.300363	3749.300363	3749.300363	6100.585441	6100.585441	6100.585441
Return (Ann.) [%]	24.014156	20.424414	21.731171	22.890266	25.049985	26.456038	27.045932
Volatility (Ann.) [%]	91.912968	33.807853	35.087176	35.916742	54.777049	56.749985	57.872688
Sharpe Ratio	0.261271	0.604132	0.619348	0.637315	0.457308	0.466186	0.467335
Sortino Ratio	0.510364	1.025442	1.068303	1.11627	0.820981	0.848901	0.860329
Calmar Ratio	0.252179	0.535256	0.566285	0.643711	0.459994	0.504152	0.542986
Max. Drawdown [%]	-96.226653	-38.158186	-38.379499	-35.55991	-54.457203	-52.476362	-48.80987
Avg. Drawdown [%]	-7.545802	-4.707023	-4.51552	-4.695019	-7.60719	-7.446307	-7.252594
Max. Drawdown Duration	2189 days 00:00:00	1196 days 00:00:00	1175 days 00:00:00	875 days 00:00:00	1316 days 00:00:00	1257 days 00:00:00	1281 days 00:00:00
Avg. Drawdown Duration	41 days 00:00:00	37 days 00:00:00	33 days 00:00:00	31 days 00:00:00	44 days 00:00:00	42 days 00:00:00	37 days 00:00:00
# Trades	1	24	28	33	32	36	43
Win Rate [%]	100	37.5	39.285714	33.333333	46.875	50	44.186047
Best Trade [%]	6225.079941	142.251142	162.169626	173.990916	232.091704	277.614477	301.509107
Worst Trade [%]	6225.079941	-8.463276	-11.536913	-10.414153	-18.256998	-18.256998	-18.256998
Avg. Trade [%]	6225.079941	15.565651	13.983741	11.967335	25.718248	26.248744	22.664625
Max. Trade Duration	6622 days 00:00:00	960 days 00:00:00	960 days 00:00:00	829 days 00:00:00	960 days 00:00:00	960 days 00:00:00	829 days 00:00:00
Avg. Trade Duration	6622 days 00:00:00	187 days 00:00:00	165 days 00:00:00	143 days 00:00:00	188 days 00:00:00	173 days 00:00:00	151 days 00:00:00

QLD, TQQQ 모두 각각 QQQ, QLD, TQQQ 신호로 백테스팅을 돌려봤습니다.
이전과 같이 QQQ 신호는 3,161, QLD 신호는 3,196, TQQQ 신호는 3,229가 각각 그 중에서는 제일 좋았습니다.
보시면 알겠지만 QQQ 신호를 그대로 사용했을 때 연평균수익률이 거의 2%p 가까이 차이나네요.
제일 왼쪽은 TQQQ 거치식 수익률인데, QQQ 신호를 사용하면 매년 매도 세금 다 내고도 거치식 대비 연평균 수익률, MDD 모두 우수한 것을 보실 수 있
니다.
전 글에서 QLD ISA와 TQQQ 직투를 비교할 때 각각 QLD 신호와 TQ 신호를 그대로 썼었고, 그때는 연평균 수익률은 크게 차이 나지 않지만 MDD는 크
차이 있었기에 QLD ISA를 좀 더 추천드렸습니다.

둘 다 QQQ 3,161 신호를 쓴다는 가정 하에선 4.15%p 정도 연평균 수익률이 차이 나서 MDD 대비 매력 이 좀 더 생겼습니다.

alt+c 댓글 쓰기

alt+w 글 쓰기

alt+q 댓글 등록

e 상단으로 d 하단으로

c 댓글로

s 이전 f 다음

q 메인 w 인기글

1 포텐터짐 2 유머

3 축구소식

22.89%도 충분히 좋은 수익률이라 TQ 몰빵보다는 QLD ISA 계좌와 섞어서 가져가시면 좋을 것 같습니다.

	QQQ ISA 9.9% 거치식	QLD ISA 9.9% 거치식	QLD 직투 22% 거치식	TQQQ 직투 22% 거치식	QQQ ISA 9.9% SMA(QQQ 신호 3, 161)	QLD 직투 22% SMA(QQQ 신호 3, 161)	QLD ISA 9.9% SMA(QQQ 신호 3, 161)	TQQQ 직투 22% SMA(QQQ 신호 3, 161)
Start	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00
End	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00	2024-08-09 0:00:00
Duration	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00	6624 days 00:00:00
Exposure Time [%]	99.956188	99.956188	99.956188	99.956188	71.872946	71.872946	71.872946	71.872946
Equity Final [\$]	105544972.6	359882013.8	305430814.3	493445845.5	72302048.43	229734388.4	418425591.6	764288752.5
Equity Peak [\$]	131567797.9	491667967.4	491667967.4	922977217.4	91441330.19	322557127.9	552388478.3	1269719658
Return [%]	955.449726	3408.820138	2954.308143	4834.456455	623.020484	2197.343884	4084.255916	7542.887525
Buy & Hold Return [%]	1064.451923	3749.300363	3749.300363	6100.585441	1064.451923	3749.300363	3749.300363	6100.585441
Return (Ann.) [%]	13.892845	21.701787	20.773344	24.014156	11.539161	18.889432	22.890296	27.045932
Volatility (Ann.) [%]	25.616373	56.322321	56.218446	91.912968	18.354974	35.388278	35.916742	57.872688
Sharpe Ratio	0.542342	0.385314	0.369911	0.261271	0.705544	0.533777	0.637315	0.467335
Sortino Ratio	0.881556	0.694069	0.657058	0.510364	1.09441	0.890915	1.11627	0.860329
Calmar Ratio	0.259424	0.258367	0.247313	0.252179	0.551304	0.530105	0.643711	0.542986
Max. Drawdown [%]	-53.552599	-83.996073	-83.996073	-95.226653	-20.930669	-35.633378	-35.55991	-49.80967
Avg. Drawdown [%]	-2.6781	-5.125221	-5.17406	-7.545852	-2.399233	-4.922297	-4.695019	-7.252594
Max. Drawdown Duration	1160 days 00:00:00	1772 days 00:00:00	1772 days 00:00:00	2189 days 00:00:00	874 days 00:00:00	1273 days 00:00:00	875 days 00:00:00	1281 days 00:00:00
Avg. Drawdown Duration	26 days 00:00:00	34 days 00:00:00	34 days 00:00:00	41 days 00:00:00	30 days 00:00:00	36 days 00:00:00	31 days 00:00:00	37 days 00:00:00
# Trades	1	1	1	1	33	43	33	43
Win Rate [%]	100	100	100	100	33.333333	44.186047	33.333333	44.186047
Best Trade [%]	1072.093209	3798.694371	3798.694371	6225.079941	72.809353	173.990916	173.990916	301.509107
Worst Trade [%]	1072.093209	3798.694371	3798.694371	6225.079941	-5.143062	-10.541505	-10.414153	-18.256998
Avg. Trade [%]	1072.093209	3798.694371	3798.694371	6225.079941	6.500466	16.162136	11.967835	22.958625
Max. Trade Duration	6622 days 00:00:00	6622 days 00:00:00	6622 days 00:00:00	6622 days 00:00:00	829 days 00:00:00	829 days 00:00:00	829 days 00:00:00	829 days 00:00:00
Avg. Trade Duration	6622 days 00:00:00	6622 days 00:00:00	6622 days 00:00:00	6622 days 00:00:00	143 days 00:00:00	151 days 00:00:00	143 days 00:00:00	151 days 00:00:00

결론입니다.

QQQ, QLD, TQQQ 모두 이동평균선 매매법 사용 시 거치식 대비 비슷한 수준의 수익률에 MDD는 크게 개선되는 것을 확인할 수 있었고, 특히 QLD ISA 계좌 활용 시와 TQQQ 직투 시에는 연평균 수익률, MDD 모두 거치식 대비 압도하는 모습을 보였습니다.

재밌는 점은 TQQQ 이동평균선 매매법 사용 시 QQQ 거치식에 비해서도 MDD가 좋았다는 점입니다. 즉, 사람들이 상대적으로 안전하다고 이야기하는 QQQ보다 TQQQ 투자가 더 안전하고 수익률도 좋을 수 있다는 말입니다.

휼쏘로 인한 손실은 대략 30~35% 정도입니다. 2006년부터 2024년까지는 총 3번의 휼쏘가 있었는데요,

2010년 6월~8월의 4번 연속 손절매,



2011년 6~12월의 5번 연속 손절매,

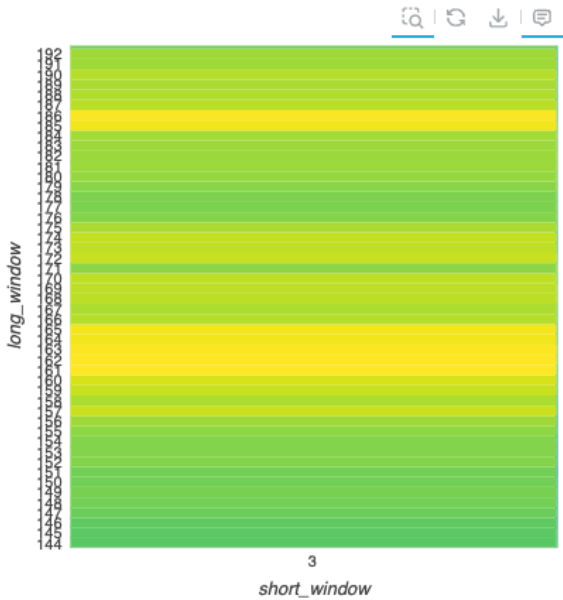


2012년 11월~12월의 3번 연속 손절매,



등이 있었습니다.

사실 이평선 전략이라는 게 웬만한 상황에서 수익률을 보장해주지만, 이런 연속 손절매가 나오면 최대 -30~40%까지 생각하셔야한다는 걸 주의하시면 좋을 것 같습니다.



마지막으로 최적화 도표 하나만 보고 가겠습니다.
장기이평선은 161일선이 제일 최적이지는 하지만, 160~165일선 모두 비슷합니다.
185,186일선도 괜찮았는데 범위가 작아서 추천드리기는 어려울 것 같습니다.
161선은 과최적화되었을 수 있으니 160~175일선 근처로 마음에 드시는 걸 선택하시면 좋을 것 같습니다.

여러모로 재미있는 결과였는데, 하나만 기억하시면 됩니다.
QQQ 3일선이 161일선을 뚫고 올라갈 때 매수하고, 3일선이 161일선을 뚫고 내려갈 때 매도한다.
QQQ, QLD, TQQQ 모두 적용되는 이야기입니다.



9/6일 주가는 이미 161일선을 뚫고 내려갔기 때문에, 이 근처에서 이틀만 더 횡보만 해도 3일선이 161일선 밑으로 내려오는 데드크로스가 일어날 것 같습니다.
8월처럼 바로 V자 반등을 하면 이번에는 매수 기회를 놓치게 되지만, 그렇지 않다면 기회를 노려보시면 좋을 것 같습니다.

↑ 보글 써주시는 모든 분들과 추천 눌러주시는 모든 분들께 항상 감사드립니다!

게시판 이력

< 이전 글

목록으로

다음 글 >

첨부파일 ▾

스크린샷 2024-09-09 오전 2.19.37.png, 스크린샷 2024-09-09 오전 2.20.58.png, 스크린샷 2024-09-09 오전 2.23.04.png,
스크린샷 2024-09-09 오전 2.37.33.png, 스크린샷 2024-09-09 오전 2.45.59.png, ...

공유하기

↑ ↓ 스크랩 📄 ...

댓글 48 개



보스감독 2024.09.09 03:38

👍 1 🗨️ 🔗

ㅇㄷ



국힘원탐_IU 2024.09.09 06:21

👍 🗨️ 🔗

ㅇㄷ



후지산대폭발슛 2024.09.09 09:30

👍 🗨️ 🔗

QQQ 기준 3일선이 161일선 골든 크로스 시 TQQQ 올인



폴딤스 2024.09.09 09:33

👍 1 🗨️ 🔗

바로 하셨네요. 대단하십니다! 고생하셨고 감사합니다 😊



eulb 2024.09.09 10:54

👍 🗨️ 🔗

폴딤스 좋은 아이디어 감사합니다 ㅎㅎ
하마터면 농치고 갈 뻔 했네요!



리비에르 2024.09.09 10:41

👍 2 🗨️ 🔗

돌고 돌아서 1배수라니 누가 알았겠는가

160에 그어둘까 165에 그어둘까

229도 그렇고 1 남는게 마음에 안 들어서 몸부림치는...



롱스톤2 2024.09.10 10:14

👍 1 🗨️ 🔗

리비에르 나는 3, 163

끝자리가 둘다 3 3 이라 기억하기 편함ㅋㅋㅋㅋ 테스트상 앞 3은 절대 못바꾸니까 ㅇㅇ



진성준 2024.09.09 16:44

👍 🗨️ 🔗

ㅇㄷ



올리버트웨스트 2024.09.09 16:49

👍 🗨️ 🔗

이글보고 티큐 올인전략 ㄱㄱ



eulb 2024.09.09 17:41

👍 🗨️ 🔗

올리버트웨스트 [가즈아](#)



올리버트웨스트 2024.09.09 16:53

👍 1 🗨️ 🔗

연저편 절세계좌도 레버리지가 되나요??



eulb 2024.09.09 17:12

👍 1 🗨️ 🔗

올리버트웨스트 연저편은 안 되고 ISA 계좌에서 2배 레버리지 상품 구매가 가능합니다.
[다만 주의하셔야 하는 게 환노출 상품은 환율이 두배로 오르내려요!](#)



딩크철 2024.09.09 17:39

👍 1 🗨️ 🔗

추천드려요



재크과자 2024.09.09 21:25

👍 1 🗨️ 🔗

jqqq 3161 tqㅇㄷ

공유 감사합니다.



무지성적립 2024.09.09 21:29

👍 1 🗨️ 🔗

감사합니다!

 제육볶음 2024.09.09 21:30   

이평선 전략
QQQ 3일선이 161일선을 뚫고 올라갈 때 매수하고, 3일선이 161일선을 뚫고 내려갈 때 매도한다.

 리사수의와인창고 2024.09.09 21:41  1  


지수 레버리지 이평선 매매법 분석추!

 오마카세 2024.09.09 21:45  1  



이번에 매수기회있으면 한번 해봐야겠네요 감사합니다

 기계유씨 2024.09.09 21:50   

좋은글 감사합니다
셋팅해놔야겠네유

 열심히모아봐요 2024.09.09 22:30   


정보추 이번엔 이걸로 매매해봐야겠드

 아기피터린치 2024.09.09 23:14  1  

이것도 증가 기준 이겠쥬?

 eulb 2024.09.09 23:15   

아기피터린치 [넵](#)

 주장레기 2024.09.10 02:05  1  


분석글들 쪽 챙겨보고 있습니다 ㄸㄸ

 wb007 2024.09.10 07:12   

정말 고맙습니다. 추천합니다!

 올리버트위스트 2024.09.10 08:46  1  

기회가 오려나 제발



 귀여운렘봉이 2024.09.10 13:31   

QqQ3161 ㅇㄷ

 세상에이런일이 2024.09.10 22:32  1  

신기한 게 또 나왔네 ㅋㅋ

새로운 가르침 감사 나중에 한번 시험해 보겠음

 Syner 2024.09.11 08:44   


ㅇㄷ

 종숙이 2024.09.11 08:55  1  

결론은 qqq차트 3,161 기준으로 tqqq매매하면 되는거쥬?

 eulb 2024.09.11 08:55  1  

종숙이 [엠펙!](#)

 종숙이 2024.09.11 08:57  1  

eulb 정보 감사합니다!

 Syner 2024.09.11 09:11  1  

분석글 감사합니다. 저는 폰으로만 매매하는데, 폰 어플에서 차트 겹치가 가능한가요??

 Syner 2024.09.11 09:12   



Syner 아니면 qqk 차트 보다가 qqk에서 뚫으면 tqqq매매해도 되겠지요?

 **eulb** 2024.09.11 09:14


👍👎🔗

Syner 네네 증가 기준이라 마감 보고 사셔도 됩니다
위블에서 차트 겹치기 가능한하더라고요

 **Syner** 2024.09.11 09:22


👍 1👎🔗

eulb 감사합니다.

 **Syner** 2024.09.11 09:24

👍 1👎🔗

혹시 다른 작성글 중에 isa계좌에서 qld 매매하는걸 보았는데요, isa는 해외주식 거래 못하지 않나요?

 **eulb** 2024.09.11 09:26


👍 1👎🔗

Syner 2배 레버리지가 있습니다
kodex 미국나스닥100 레버리지만 tiger랑 있는데 하나는 환헛지고 하나는 환노출이예요
환노출은 환율도 레버리지가돼서 조심하셔야 합니다

 **Syner** 2024.09.11 09:26


👍👎🔗

eulb 감사합니다. 그럼 환헛지 상품을 추천하시나요?

 **eulb** 2024.09.11 09:27

👍 1👎🔗

Syner 저는 1300원 이상이라 환헛지로 샀어요
1200원 대까지 떨어지면 환노출로 스위칭 해볼만 한 것 같습니다

 **Syner** 2024.09.11 09:31

👍👎🔗

eulb 댓글 감사합니다.

 **에펠펙코리아수호대** 2024.09.11 11:43

👍👎🔗

개추

 **#MACD** 2024.09.11 12:52


👍👎🔗

3 161 ㅇㄷ

 **워랭** 2024.09.12 00:22

👍👎🔗

3 161 ㅇㄷ

 **몽디니** 2024.09.12 07:28

👍👎🔗

혹시제가 이해한게맞다면
3,161에서 가장 최근 티큐 매수타이밍이
8월9일이고 그이후로는 교차되지않았으니 계속가지고있어야가능케 맞는건가요?!

 **eulb** 2024.09.12 09:49

👍 1👎🔗

몽디니 오우옴 맞습니다!

 **몽디니** 2024.09.12 09:53

👍👎🔗

eulb 아하 답변감사드립니다!!
200/3,161 둘다열심히 공부해봐야겠습니당
오늘도 좋은하루 되세요!

 **eulb** 2024.09.12 09:53

👍 1👎🔗

몽디니 넵 좋은하루 되세요!!!

 **위드1** 2024.09.12 23:43

👍👎🔗

↑

↓

💬

시장tqqq매매법ㅇㄷ

댓글 쓰기

댓글 작성 하시려면 로그인 해주세요. 로그인 하시겠습니까?

ㄷㄷ

검색

주식공지 보기

인기

답답

국내주식

해외주식

질문

정보공유

종목추천,분석

실적발표

매매기법

이벤트

공지

탭	제목	글쓴이	날짜	조회	추천
답답	한페이지에 글 백개쓰고 블라 안당하는방법 6	겔무새	24.09.09	116	7
답답	은하 5 📺	티벳사자의서	24.09.09	208	4
답답	사실 저번 t1때 올인 한번 할려고했음 4	돌아온지수추종러	24.09.09	111	4
답답	글은 쓸수록 농염해짐 1	겔무새	24.09.09	240	4
답답	진짜 다 자라갔다냥!! 9 📺	티벳사자의서	24.09.09	183	5
답답	미리 밤새 무덤파는중.	망국장	24.09.09	133	2
답답	아무도 글 안쓰는사이 7	겔무새	24.09.09	132	6
답답	엔캐리 트레이더들 스퀴즈해서 벌는거 다 삼키는 시나리오임? 8	20톤구름제조기	24.09.09	909	6
해외주식	엔캐리가 끝나가는것입니다. 4	티벳사자의서	24.09.09	2814	9
답답	국장 어디까지 내려갈지 설문하는데 5	겔무새	24.09.09	219	6
매매기법	TQQQ 이동평균선 매매법 최적화 5편(QQQ 이평선 사용) 48 📺	eulb	24.09.09	6만	58
국내주식	월요일부터 국장은 야수의 심장들만 살아남는다 4 📺	망치나가심	24.09.09	573	3
해외주식	속슬 언제물타면되나요	안알	24.09.09	213	3
답답	정보글	겔무새	24.09.09	102	7
답답	SEVENTEEN Live at Lollapalooza Berlin (2024) 33만명 실시간 시청 중 6 📺	티벳사자의서	24.09.09	247	5
답답	포텐 엔캐리 트레이드 원소리임 11	tqqq트레이더	24.09.09	2232	8
답답	햇살론 받아보신분 1	lb가고싶다	24.09.09	443	3
답답	베너 사이클 📺	사마휘	24.09.09	1만	2
해외주식	엔캐리 트레이드는 역사적으로 꾸준히 있었지만 이번만큼은 다름 6	휼슬리지말기	24.09.09	1만	64
답답	요즘 미장시간에 보면	겔무새	24.09.09	108	3
국내주식	근데 진짜 국장 2000언더도 가능하려나 2	망치나가심	24.09.09	594	5
해외주식	진짜 오늘 존나 무섭다 진짜로 10	김호티	24.09.09	2112	7

제목+내용 ▼

3. 조선

인기글

오래된 문서는 이전/다음 페이지가 생략됩니다.

1 페이지로 가기

