


전문가용) eulb's 나스닥 레버리지 이동평균선 매매법 - 5편. 백테스팅(이평선 및 레버리지 배율)2025.01.07 02:49

 eulb

조회수 21998추천수 45댓글 27

## 강력 경고

이 매매법은 전문가를 위한 매매법으로, 원칙을 지키지 않는다면 매우 큰 손실을 볼 수 있는 매매법입니다.  
아래 목록 중에 하나라도 해당하시는 분들은 바로 뒤로가기를 누르시기 바랍니다.

1. TQQQ 200일선 매매법을 시작했으나 중간에 못 참고 전량 매도한 적이 있는 사람
2. 엔비디아, 삼성, 테슬라, DJT, MSTR, 양자컴퓨터 등 테마주를 FOMO 못 참고 매수한 적이 있는 사람
3. 매매 주기가 3개월보다 짧은 사람
4. 기본적인 금융 지식이나 시장에 대한 이해가 부족한 사람
5. 시장에 대한 객관적인 분석보다 '촉'이나 '느낌'으로 매매를 결정하는 사람
6. 매매에 들어가기 전에 원칙을 세우지 않거나, 세우더라도 지키지 않았던 적이 있는 사람
7. 손실을 인정하지 못하고 무조건 복구하려는 '복수 매매' 성향이 있는 사람
8. 손절을 못하고 끝까지 들고 가는 사람
9. 멘탈 관리가 취약해서 작은 손실에도 크게 흔들리는 사람
10. 장기적인 계획 없이 단기적인 '한탕주의'로 접근하는 사람

마지막으로 다시 한 번 경고드립니다. 위 목록에 해당하지 않는 분들이라도 충분한 리스크를 감당할 자신이 없다면 여기서 그만두시길 강력히 권고드립니다.  
모든 투자의 책임은 전적으로 투자자 본인에게 있으며, 이후의 투자 결과에 대해서는 책임지지 않습니다.

무엇보다 중요한 점은, 이 매매법을 성공적으로 활용하려면 매매 원칙을 철저히 세우고 반드시 지켜야 한다는 것입니다.  
원칙 없는 매매는 결국 실패로 이어집니다.  
백테스팅에 근거한 명확한 전략 하에, 순간적인 감정에 따라 매매하지 않을 자신이 있는 분만 다음으로 넘어가 주시기 바랍니다.

- 전문가용) eulb's 나스닥 레버리지 이동평균선 매매법
- 1편. 개요: <https://www.fmkorea.com/7883979900>
- 2편. 개념 정리: <https://www.fmkorea.com/7884117396>
- 3편. vs 레버리지 ETF: <https://www.fmkorea.com/7895606851>
- 4편. 백테스팅 가정: <https://www.fmkorea.com/7897030490>
- 5편. 백테스팅(이평선 및 레버리지 배율): <https://www.fmkorea.com/7897075860>

이번 편에서는 본격적으로 백테스팅 결과를 공유하겠습니다.  
기본적인 가정에 대해서는 4편을 참고해주세요.  
하나 추가할 가정이 있는데, 기간은 2006.06.21 ~ 2024.12.31입니다.

이번에 비교할 조건은 총 네 개입니다.

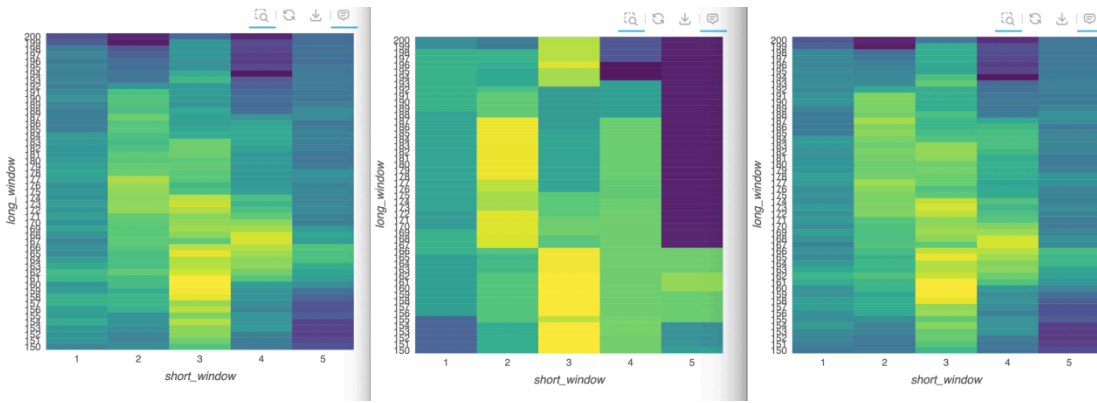
1. 신호 차트: NDX vs NQ1!
2. 단기 이평선, 장기 이평선
3. 매매 차트: QQQ vs QLD vs TQQQ vs NQ1! vs NQ2!
4. 레버리지 배율

하나씩 빠르게 가보겠습니다.

1. 신호 차트: NDX vs NQ1!
  2. 단기 이평선, 장기 이평선
- 매매 차트는 NQ1!, 레버리지 배율은 3으로 두고 각 이평선에 따른 연간 수익률, MDD, Sortino Ratio를 비교해보겠습니다.  
NDX 차트를 신호차트로 쓴 결과입니다.



단축키	설정하기
<div>alt+c</div>	댓글 쓰기
<div>alt+w</div>	글 쓰기
<div>alt+q</div>	댓글 등록
<div>e</div>	상단으로
<div>c</div>	댓글로
<div>s</div>	이전
<div>q</div>	메인
<div>1</div>	포텐터짐
<div>3</div>	축구소식
<div>d</div>	하단으로
<div>f</div>	다음
<div>w</div>	인기글
<div>2</div>	유머

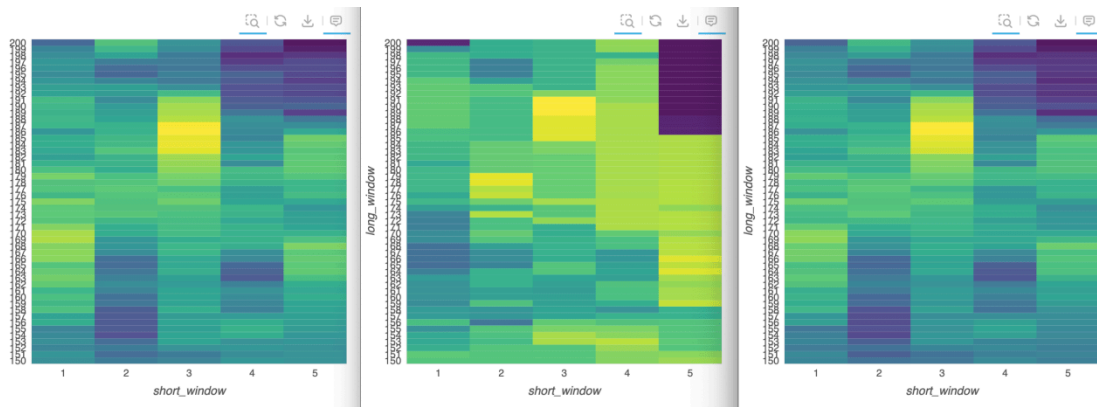


차례대로 연간 수익률, MDD, Sortino Ratio입니다.

가로축이 단기 이평선, 세로축이 장기 이평선입니다.  
 노란색 -> 파란색으로 갈수록 값이 낮아진다, 안 좋아진다고 보시면 됩니다.

익히 알고 있는 사실처럼 3,161선이 22.187%로 가장 연간 수익률이 좋았습니다.  
 MDD는 단기 이평선은 3일선을 쓰고 장기 이평선은 166일선보다 작기만 하면 다 비슷했습니다.  
 따라서 Sortino Ratio도 3,161선에서 1.222로 제일 높게 나왔네요.

다음은 NQ1! 차트에 대한 결과입니다.



기억하시는 분들이 있는지 모르겠는데, QLD와 TQQQ 차트를 비교했을 때도 변동성 끌림 때문에 NDX 선보다 장기 이평선을 사용해야 좋은 결과가 나왔습니다. NQ1!도 변동성 끌림은 없지만 시간 가치가 녹기 때문에 NDX 선보다 장기 이평선을 사용해야하는 걸 알 수 있습니다.

3,187선에서 20.074%로 연간 수익률은 가장 좋았습니다.  
 MDD는 3,190선에서 -34.556%로 제일 좋았습니다.  
 Sortino Ratio는 3,187에서 1.102로 가장 좋았습니다.

NDX 차트와 NQ1! 차트의 비교에서는 NDX 선이 우월하다는 것을 알아냈습니다.  
 결국 레버리지 ETF던지 선물이던지 기초지수와 괴리가 없는 NDX 선이 제일 좋았네요.

### 3. 매매 차트: QQQ vs QLD vs TQQQ vs NQ1! vs NQ2!

추가로 적용할 가정이 있습니다. TQQQ의 경우 상장 시점이 2010년이라 이를 모사하기 위해 QLD 일간 변동성의 1.5배를 추종하는 모의 지수를 만들었습니다. NDX 및 QQQ의 3배 추종 모의 지수는 스왑 이자가 충분히 반영되지 않아 오차가 있습니다.

방법론에 대해서는 설명드렸으니, 바로 결과 공유만 가도록 하겠습니다.  
 모두 NDX 3,161선이 제일 좋았고, 해당 결과의 비교입니다.

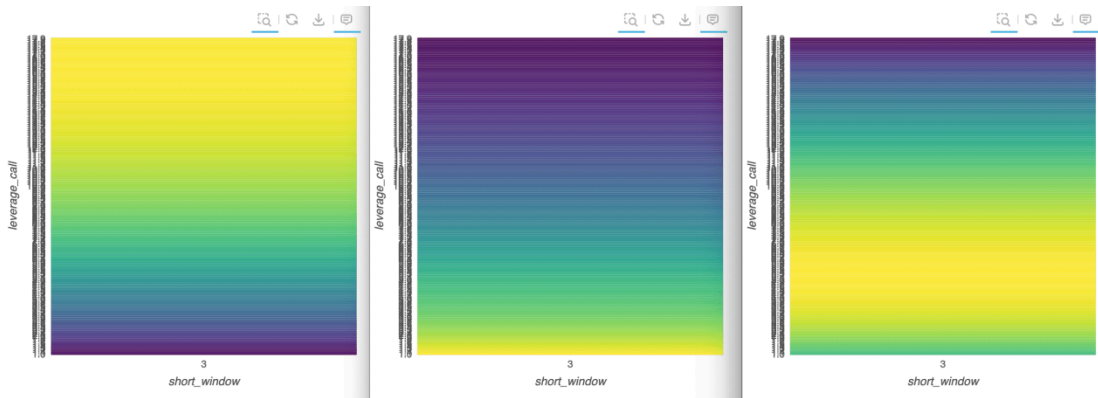
	QLD_1.5x	QLD	QQQ	NQ2! 3x	NQ1! 3x
Start	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00	2006-06-21 0:00:00
End	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00
Duration	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00
Exposure Time [%]	72.448542	72.448542	72.448542	72.478047	72.338606
Equity Final [\$]	1997035002	500596195.1	98981677.85	441416931987	412557361.7
Equity Peak [\$]	2284316947	546297508.4	103146198.9	491247839542	459915407.7
Return [%]	19870.35002	4905.961951	889.816778	4314.16932	4025.573617
Buy & Hold Return [%]	10445.25602	5451.324156	1442.746953	471.084498	462.105263
Return (Ann.) [%]	33.13488	23.544893	13.185475	22.681042	22.186946
Volatility (Ann.) [%]	60.327134	36.359386	16.495746	32.442389	31.999774
Sharpe Ratio	0.549253	0.64756	0.799326	0.699118	0.693347
Sortino Ratio	1.069532	1.139847	1.273352	1.23808	1.221852
Calmar Ratio	0.619414	0.599125	0.60969	0.697133	0.693775
Max. Drawdown [%]	-53.493887	-39.298817	-21.626531	-32.534763	-31.980053
Avg. Drawdown [%]	-6.861405	-4.587016	-2.354202	-3.934935	-3.875304
Max. Drawdown Duration	1274 days 00:00:00	1244 days 00:00:00	575 days 00:00:00	815 days 00:00:00	815 days 00:00:00
Avg. Drawdown Duration	35 days 00:00:00	32 days 00:00:00	28 days 00:00:00	28 days 00:00:00	28 days 00:00:00
# Trades	32	32	32	32	32
Win Rate [%]	37.5	37.5	37.5	37.5	37.5
Best Trade [%]	301.509095	173.990908	74.259147	60.854926	59.877734
Worst Trade [%]	-15.908256	-10.414136	-5.143037	-3.143356	-3.115653
Avg. Trade [%]	18.001372	13.007949	7.426435	5.097915	4.990178
Max. Trade Duration	829 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	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00
Profit Factor	7.275295	6.74711	6.600047	7.104539	7.039416
Expectancy [%]	30.977039	18.695606	8.909254	5.845244	5.709775
SQN	2.13833	2.299697	2.533695	2.221801	2.230529

먼저 NQ1!과 NQ2!를 비교하자면, NQ2!가 성과가 미세하게나마 더 좋았습니다.  
아마 차근월물의 시간 가치 감소 속도가 최근월물의 속도보다 더 느리기 때문이 아닐까 생각이 드는데요,  
큰 차이가 아니기 때문에 어느 쪽을 선택하셔도 좋을 것 같습니다.  
차근월물의 경우에는 호가 간격이 넓어 스프레드 비용이 있기 때문에 아마 결과적으로는 비슷할 수도 있다고 생각합니다.  
아니면 차근월물로 하고 롤오버 간격을 길게 가져가는 것도 방법이겠네요.

백테스팅할 때는 NQ2!로 비교하도록 하겠습니다.

QQQ, QLD, QLD\_1.5x와 비교하면, QLD와 제일 비슷하네요.  
MDD는 더 나운데 반해 연간 수익률은 비슷합니다.  
선물에는 양의 복리가 적용되지 않아 3배만으로는 레버리지 ETF들의 수익률과 비슷하거나 모자란 것을 확인할 수 있습니다.

#### 4. 레버리지 배율



레버리지 배율을 1.0 ~ 18.0배까지 변동한 결과입니다.  
연간 수익률은 18배까지도 계속 늘어나는 결과를 보여줍니다.  
결과적으로 청산만 되지 않으면 레버리지는 쓰면 쓸수록 수익률이 좋다는 걸 알 수 있습니다.  
연간 수익률은 대략적으로 다음과 같습니다.  
1.0: 8.965% ~ 18.0: 56.774%

여기서 재밌는 것은 선물 1배의 경우엔 수익률이 1배 ETF보다 낮는데, 그 이유는 전편에서 밝혔듯이 기초지수가 상승할수록 배율이 감소하기 때문입니  
18배는 뭐 말도 안 되는 수익률이네요.  
MDD는 거꾸로군요.  
QQQ: -15.607% ~ 18.0: -90.233%  
TQQQ 거지식의 MDD가 -90% 정도였던 걸 생각해보면, 18배 선물도 TQQQ에 비하면 그렇게 위험하지 않을지도?라는 생각이 듭니다.  
아니, 거꾸로 TQQQ 거지식이 18배 선물 급으로 위험하다는 뜻일 수도 있겠네요.

Sortino Ratio는 1.0에서 1.153으로 시작해 점점 증가하다가 4.9~5.5배에서 1.261로 최고점을 찍고 점점 감소해 18.0에서 0.929로 최저를 찍네요.

종합해보면 MDD와 수익률을 모두 고려했을 때, Sortino Ratio가 가장 높은 5.5배가 제일 좋다는 걸 알 수 있습니다.  
5.5배는 CAGR(연간 수익률) 35.225%, MDD -44.527%입니다.

조금 더 욕심을 부려본다면, MDD -50% 정도까지는 괜찮지 않을까요?  
QQQ 거치식도 MDD가 -50%에 달하는 걸요.  
레버리지 6.5배에서 MDD -49.893%, CAGR 39.22%, Sortino Ratio 1.255입니다.  
Sortino Ratio도 5.5배랑 크게 차이 안 나고 괜찮은 것 같네요.

한번 더 욕심을 부려볼까요? 아까 NDX 3,161선 QLD\_1.5x의 MDD가 -53.49%였으니까 여기까지 늘려보겠습니다.  
7.2배가 MDD -53.526%, CAGR 41.723%, Sortino Ratio 1.248입니다.

마지막으로 욕심을 부려보겠습니다. 나는 정말 욕심쟁이고 야수다! MDD -60%!  
8.4배가 MDD -59.688%, CAGR 45.5%, Sortino Ratio 1.23입니다.

솔직히 이 이상은 별로 추천드리고 싶지 않습니다.  
MDD -60% 이상은 아무리 야수라고 해도 버티기 힘들기 때문에 제가 추천하고 싶은 건 딱 여기까지입니다.

	3배	5.5배	6.5배	7.2배	8.4배
CAGR	22.68	35.23	39.22	41.72	45.50
MDD	-31.98	-44.53	-49.89	-53.53	-59.69
Sortino Ratio	1.222	1.261	1.255	1.248	1.230

	NQ2! 10x	NQ2! 9x	NQ2! 8x	NQ2! 7x	NQ2! 6x	NQ2! 5x	NQ2! 4x	NQ2! 3x
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	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00	2024-12-31 0:00:00
Duration	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00	6768 days 00:00:00
Exposure Time [%]	72.478047	72.478047	72.478047	72.478047	72.478047	72.478047	72.478047	72.478047
Equity Final [\$]	17444668898	12847406758	8942143550414.60...	5841090964130.50...	3547759053628.24...	1978851544840.24...	996221770464	441416931987
Equity Peak [\$]	21477397101	15676230013	10800675807034.1...	6973463340405.75...	4178945324150.74...	2294544299585.74...	1133830245154.96...	491247839542
Return [%]	174346.689	128374.0676	89321.4355	58310.90964	35377.59054	19688.51545	9862.217705	4314.16932
Buy & Hold Return [%]	471.084498	471.084498	471.084498	471.084498	471.084498	471.084498	471.084498	471.084498
Return (Ann.) [%]	49.61058	47.1608	44.310589	41.031465	37.286777	33.028392	28.19093	22.681042
Volatility (Ann.) [%]	99.738863	90.093174	80.49753	70.934512	61.384786	51.819807	42.196198	32.442389
Sharpe Ratio	0.497405	0.523467	0.550459	0.578441	0.607427	0.63737	0.668092	0.699118
Sortino Ratio	1.196676	1.21856	1.236651	1.250332	1.258745	1.260735	1.254668	1.23808
Calmar Ratio	0.740355	0.753958	0.767941	0.782408	0.788647	0.793459	0.749023	0.697133
Max. Drawdown [%]	-67.009216	-62.550946	-57.700509	-52.442534	-47.279435	-41.62584	-37.63692	-32.534763
Avg. Drawdown [%]	-7.632049	-7.079475	-6.647495	-6.208922	-5.954036	-5.364887	-4.718288	-3.934935
Max. Drawdown Duration	1277 days 00:00:00	1273 days 00:00:00	1257 days 00:00:00	1244 days 00:00:00	854 days 00:00:00	853 days 00:00:00	853 days 00:00:00	815 days 00:00:00
Avg. Drawdown Duration	28 days 00:00:00	28 days 00:00:00	27 days 00:00:00	27 days 00:00:00	27 days 00:00:00	27 days 00:00:00	28 days 00:00:00	28 days 00:00:00
# Trades	32	32	32	32	32	32	32	32
Win Rate [%]	37.5	37.5	37.5	37.5	37.5	37.5	37.5	37.5
Best Trade [%]	60.854926	60.854926	60.854926	60.854926	60.854926	60.854926	60.854926	60.854926
Worst Trade [%]	-3.143356	-3.143356	-3.143356	-3.143356	-3.143356	-3.143356	-3.143356	-3.143356
Avg. Trade [%]	5.097915	5.097915	5.097915	5.097915	5.097915	5.097915	5.097915	5.097915
Max. Trade Duration	829 days 00:00:00	829 days 00:00:00	829 days 00:00:00	829 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	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00	152 days 00:00:00
Profit Factor	7.104539	7.104539	7.104539	7.104539	7.104539	7.104539	7.104539	7.104539
Expectancy [%]	5.845244	5.845244	5.845244	5.845244	5.845244	5.845244	5.845244	5.845244
SQN	1.618082	1.667766	1.725983	1.794879	1.877082	1.975395	2.091493	2.221801

다음 편에서는 기타 조건에 대해 알아보겠습니다.  
재밌게 읽으셨으면 추천 한번씩 부탁드립니다!

4편도 추천 부탁드립니다 ㅎㅎ  
<https://www.fmkorea.com/7897030490>

게시판 이력

45

< 이전 글

목록으로

다음 글 >

첨부파일 ▾ image.png, image.png, image.png, image.png, image.png, ...

↑ ↓ 스크랩 📄 ...

댓글 27 개

🐶 드라이브형식 2025.01.07 02:55

👍 1 🗨️ 🔗

↑ ↓

전문추

🐶 페이데이 2025.01.07 02:56

👍 1 🗨️ 🔗

👍

 송알송알 2025.01.07 04:09  1  

열심히 읽고있는데 너무 재밌네요 생각도 못했던 선택지였는데 아직 선물 할 실력은 안되지만 식견이 넓어지는 기분입니다bb

 보라미8 2025.01.07 04:11  1  

기존 3 161도 사실 엄청 매력적인 수익률인데 거의 2배라니 기계적으로 할수만 있다면 정말 좋아보여요!  
감사합니다

 보라미8 2025.01.07 04:38  1  



선생님 한가지 궁금한것이 선물끼리의 레버리지 배율 비교를 할때는 증거금 포함 총 시드의 크기가 동일하다고 생각을해야할까요?

  eulb 2025.01.07 14:20  1  

보라미8 엇 이해를 잘 못했는데 예시를 들어주실 수 있으실까요?

  보라미8 2025.01.07 16:33  1  

eulb 예를 들어서 선물로 레버리지를 할때 1배로 하려면 증거금을 엄청 많이 가지고 있어야 하고 반대로 18를 하려면 증거금을 조금만 가지고 있어도 되는데 이런경우에 총시드를 같다고 가정할수가 있을까요? ETF 는 1배 2배 3배 자기가 가진 모든돈을 다 투자하면 같은 시드로 시작이 되는건데 선물의 경우 1배수와 18배수가 같은 시드로 시작하는 개념이 가능한지 잘 이해가 안가서 질문드렸습니다. ππ

  eulb 2025.01.07 18:07  1  

보라미8 아하 이해했습니다.

정확히 어떤 방법으로 투자해야하는지는 추후 자세히 설명드릴텐데, 간략히 말씀드릴게요.

선물을 20배수로 가정하고, 시드는 100일 경우

내 시드를 전부 선물에 넣으면 명목 가치는 20배인 2000이 됩니다.

1배수로 하고 싶으면 시드의 20분의 1인 5만 선물에 넣으면 됩니다. 그럼 명목 가치는 5의 20배인 100이 되고, 내 자산 가치인 100과 명목 가치 100이 같아지므로 1배율이 되는 거죠.

4배수를 구현하고 싶으면 20분의 4인 20을 선물에 넣으면 됩니다.

  보라미8 2025.01.07 18:20  1  

eulb 네 친절한 설명 감사드려요!

그럼 100을 기준으로 할때

비교대상이 etf 일경우에는

100 전부를 etf 구매하는경우 vs 5배수라면 선물20현금80


인경우로 수익률이 비교가 되고

비교대상이 서로 선물인 경우에는

100전부를선물구매해서 레버리지 20배 vs 선물20현금80 레버리지4배

인 경우로 수익률이 비교가 되겠네요?


결국 선물로 레버리지를 하면 현금을 80% 나 남기면서도 100을 투입한 etf 보다도 효율이 좋더라고 이해가 되는데 맞을까요?

  eulb 2025.01.07 18:28  1  

보라미8 오우 네네 정확합니다.

선물에 투입한 돈을 전부 위탁증거금으로 사용해서 계약을 한다고 보시면 됩니다.

실제로는 위탁증거금이 변동 되기도 하고 현재 지수에 따라서도 배율이 출렁여서 정확한 배율 계산 방법은 추후에 공유드리도록 하겠습니다

  보라미8 2025.01.07 18:29  1  

eulb 항상 감사합니다!

 희희호물이 2025.01.07 08:38  1  

선물할 날이 있을까 싶었는데 공부해보고싶어지네요 좋은글 감사합니다.

  희희호물이 2025.01.07 09:59  1  

희희호물이 2번 항목에서 궁금한 점이 있는데 qld tqqq 비교시엔 변동성 끌림 때문에 NDX보다 장기가평선이 낮다.(NQ1! 마찬가지로) 그다다음 부분에 NDX NQ1! 비교시엔 NDX 선이 우월함 -> 레버리지/etf/선물 모두 NDX가 제일 좋다고 되어있습니다.

위에선 장기가평 아래에선 NDX 선이 좋다고 되어있는데 왜 그런건가요?

이전 4편의 4. 부분에선 '각 이평선 보단 NDX 차트가 낮다'라고 되어있습니다.

제가 잘못 이해한 부분이 있을까요?

  eulb 2025.01.07 14:20  1  

희희호물이 아 이부분 제 설명이 좀 부족했던 것 같네요

이전 qld tqqq 백테스팅 결과에서는 만약 qld, tqqq차트를 쓴다면 ndx선의 3,161선보다 장기가평선을 사용해야 최적이었고, 그래도 ndx 3,161선보다는 결과가 좋지 않았습니다.


마찬가지로 이번에도 3,161선보다 장기 이평선인 3,187선을 사용해야 최적이었고, 그래도 ndx 3,161보다 결과가 좋지 않았음을 알 수 있습니다.

왜 ndx차트가 아닌 레버리지 etf나 선물 차트를 신호로 사용하였을 때 더 장기 이평선이 되고 결과도 별로인지에 대해서 고찰해보니, 둘 다 변동성 끌림 혹은 시간 가치 감소로 인하여 ndx보다 과리되었기 때문이 아닌가 추측한 내용입니다.

 **힉힉호몰이** 2025.01.07 14:52

 1  

eulb 자세한 설명 감사드립니다

 **팍시코디즈니** 2025.01.07 09:22

 1  

장투로 하려면 선물계좌 하나파서 5.5배로 맞춰놓고 오래 끌고가는게 제일 좋다는 결론이군요  
아이디어만 있고 검증은 못했었는데  
좋은 정보 감사합니다 !

 **비타민주** 2025.01.07 10:08


 1  

주식하시는 분들도 보통 선물에 대해서는 잘 모르시는데 2번 개념정리 잘 해주셨네요 ㅈㅈㅈㅈ

 **이창용** 2025.01.07 10:14

 1  

개추  
전에 백테스팅 할때 레버리지 1배씩 올려보다가,  
선물 5배가 QLD 1.5배랑 연 수익률이 비슷해서 전략 파기했었는데  
5.5까지만 가면 되는거였군요

 **데미언샤젤** 2025.01.07 14:51

 1  

중네요 저도 야수의 심장으로 영국장qqq5 고려했었는데 대응의 영역에선 선물만한게 없는듯

 **eulb** 2025.01.07 17:59

데미언샤젤 5배 레버리지 etf보다는 선물이 훨씬 안전한 것 같긴 합니다 ㅋㅋ

 **NASDAQ** 2025.01.08 05:50

 1  

올려주신글 정말 잘 읽고 있습니다. 양질의 글 써주셔서 감사합니다.  
파이썬 코드로 QQQ 3, 161일선 기준 TQQQ 백테스트 해보고 있습니다.

제가 백테스트 할 때는(수수료, 세금 제외)  
2010년 4번의 휩소에서 손실이 25.9%  
2011년 5번의 휩소에서 손실이 34.7%가 나오는데  
(파이썬으로 돌렸다가 이상해서 그냥 데이터값 뽑아서 계산기 돌려봐도 똑같더라구요)

전에 백테스트 하실 때 쓰신 댓글에는  
2010년 휩소 손실: 원작 -15.3%, 개량 -17.2%  
2011년 휩소 손실: 원작 -24.9%, 개량 -29.1%

혹시 제가 어느 부분에서 잘못 계산한 건지 알 수 있을까요...  
[댓글이 수정되었습니다: 2025-01-08 06:01:51]

 **eulb** 2025.01.09 15:42

NASDAQQ 학 그렇네요! 제가 실수했습니다.  
MDD의 증가폭(%p)으로 단순 계산했는데 그게 아니라 증가율로 계산했어야하네요.

NDX 3,161 / QLD\_1.5x로 다시 계산해본 결과 다음과 같습니다.  
10년 4번 -33.27%  
11년 4번 -42.24%

QLD\_1.5x 1,200 / QLD\_1.5x  
10년 5번 -28.12%  
11년 5번 -31.65%

백테스팅 오류 잡아주셔서 감사합니다!!!

 **eulb** 2025.01.09 15:48

eulb trade data는 다음과 같습니다.


10년 4번  
Size EntryBar ExitBar ... EntryTime ExitTime Duration  
0 8807002 273 276 ... 2010-06-02 2010-06-07 5 days  
1 7547705 282 290 ... 2010-06-15 2010-06-25 10 days  
2 7108863 310 314 ... 2010-07-26 2010-07-30 4 days  
3 6732265 315 323 ... 2010-08-02 2010-08-12 10 days

 **eulb** 2025.01.09 15:48


  



eulb 11년 4번  
Size EntryBar ExitBar ... EntryTime ExitTime Duration  
0 5082256 190 214 ... 2011-06-30 2011-08-04 35 days  
1 4701148 245 247 ... 2011-09-19 2011-09-21 2 days  
2 4479659 262 289 ... 2011-10-12 2011-11-18 37 days  
3 4249246 298 306 ... 2011-12-02 2011-12-14 12 days

-  META

2025.01.09 09:14

1
- 정보추!
-  허언구

2025.01.09 11:23

1
- 기타조건 기다리고있어용 ㅎㅎ 좋은글 감사합니다!
-  하이킨아시

2025.01.11 15:06
- 정독하고 있습니다 개추

댓글 쓰기

댓글 작성 하시려면 로그인 해주세요. 로그인 하시겠습니까?

등록

- 계시판 검색
- 전체 검색
- 커뮤니티 검색

주식

공지 보기

인기

잡담

국내주식

해외주식

질문

정보공유

종목추천,분석

실적발표

매매기법

이벤트

공지

탭	제목	글쓴이	날짜	조회	추천
매매기법	전문가용) eulb's 나스닥 레버리지 이동평균선 매매법 - 5편. 백테스팅(이평선 및 레버리지 배율) 27 	 eulb	25.01.07	2만	45
잡담	매매법 4편 인기글 가면 5편 올릴게요 1	 eulb	25.01.07	206	7
매매기법	전문가용) eulb's 나스닥 레버리지 이동평균선 매매법 - 4편. 백테스팅 가정 16 	 eulb	25.01.07	1만	56
잡담	인기글 가면 매매법 4편 올리겠습니다 4	 eulb	25.01.07	600	16
잡담	나스닥 레버리지 매매법 끝을	 eulb	25.01.06	498	8
매매기법	전문가용) eulb's 나스닥 레버리지 이동평균선 매매법 - 3편. vs 레버리지 ETF 19 	 eulb	25.01.06	1만	59
잡담	매매법 3편 다 썼는데 아직 못 올림 ㅠ 6	 eulb	25.01.04	232	16
해외주식	포모 미치는 이유 3	 eulb	25.01.04	965	7
잡담	소수점 주식 조심하세요 2	 eulb	25.01.03	2039	7
매매기법	전문가용) eulb's 나스닥 레버리지 이동평균선 매매법 - 2편. 개념 정리 20	 eulb	25.01.03	9735	67
잡담	매매법 2편 완료 6	 eulb	25.01.03	536	11
매매기법	전문가용) eulb's 나스닥 레버리지 이동평균선 매매법 - 1편. 개요 45 	 eulb	25.01.03	2만	74
잡담	신규 매매법 소개글 정리했는데 지금 ㄱ? 8 	 eulb	25.01.03	674	11
해외주식	나스닥 사고 싶은데 돈이 없다	 eulb	25.01.02	225	
잡담	새로운 매매법 발견함 10	 eulb	25.01.01	2960	22
해외주식	혹시 yahoo finance 구독하시는 분 있나요?	 eulb	25.01.01	173	
잡담	포텐 ㄹㅇ 개박세네 5	 eulb	24.12.27	1348	8
해외주식	IRP 안전자산 TDF KODEX에서 PLUS로 바꿈 1	 eulb	24.12.26	742	1
정보공유	올해 안에 당장 시작해야하는 연금저축펀드 투자법 FAQ 203 	 eulb	24.12.22	11만	175
답	연저편 FAQ 다 썼는데 4	 eulb	24.12.22	228	3

56646640

회원번호 ▾

8. 팔란 +1

인기글

