



Sentistock 포트폴리오

모의투자 시뮬레이션



뉴스, 차트, 수많은 지표 속에서 “지금 무엇을 믿어야 할지” 막막했던 순간들.
우리는 그 질문에 답하기 위해, 우리 서비스를 기반으로 수행된 모의투자 시뮬레이션 결과를 데이터 중심의 포트폴리오 리포트로 담아냈습니다.

Explore Now



Index

1

모의투자 소개

sentistock 서비스 검증

2

모의투자 설계

시뮬레이션 환경 설정 및 설계

3

모의투자 시뮬레이션 결과

알파스퀘어를 활용한 시뮬레이션 환경

4

결과 및 관계 분석

감정 지표와 수익률의 관계

5

마무리

결론 및 시사점

모의투자 시뮬레이션 의의

주식 모의투자는 실제 금전적 위험 없이 의사결정 과정을 통해 투자 심리와 시장 흐름을 이해하는 데 효과적인 방법으로 알려져 있습니다. 선행 연구에 따르면, 모의투자는 투자자의 감정 변화와 의사결정 패턴을 관찰하고, 시장 상황에 따른 심리적 반응을 학습하는 데 의미 있는 교육적 효과를 가진다고 보고됩니다(경제교육연구, 2011).

이러한 배경에서 우리는 뉴스 기반 감정 분석이라는 정성적 지표가 실제 투자 판단 과정에서 어떻게 인식되고 활용되는지를 확인하기 위해 모의투자 시뮬레이션을 선택했습니다.

모의투자 시뮬레이션 목적

본 시뮬레이션은 단순한 수익률 비교가 아니라 투자자가 시장을 바라보는 관점과 판단 흐름 속에서 감정 지표가 어떤 역할을 수행할 수 있는지를 살펴보는 데 목적이 있습니다.

출처 : 한국경제교육학회, 「주식모의투자의 투자심리 효과와 경제교육 효과」, 경제교육연구, 18(2), 2011.

실험 조건

본 모의투자 실험은 투자 판단 방식의 차이가 의사결정 과정에 어떤 영향을 미치는지를 관찰하기 위해 설계되었습니다.

실험은 동일한 투자 기간, 동일한 종목군, 동일한 초기 자본을 기준으로 진행되었으며, 시장 환경과 자본 조건에 따른 영향을 최소화하였습니다.

이를 통해 각 투자자가 서로 다른 판단 기준을 사용하더라도, 비교가 가능하도록 실험 환경을 통제하였습니다.

투자 판단 방식

일반 투자자 그룹은 이동평균선과 볼린저 밴드를 활용한 추세 추종형 전략을 기준으로 차트 신호와 가격 흐름에 따라 매수·매도 시점을 판단하였습니다. 반면 감정 분석 기반 투자자 그룹은 차트 분석을 직접 활용하지 않고, SentiStock이 제공하는 뉴스 감정 분석 기반 투자 알림만을 참고하여 매수·매도 여부를 결정하였습니다. 즉, 두 그룹의 차이는 동일 전략에 감정 지표를 추가했는지 여부가 아니라, 의사결정의 기준 자체가 서로 다르다는 점에 있습니다.

※본 실험은 서로 다른 투자 판단 기준을 사용하는 두 그룹의 의사결정 과정 차이를 비교하기 위해 설계

모의투자 시뮬레이션 결과

센티스톡 사용자

종목명	보유기간	실현손익	수익률
삼성전자	26.01.09 ~ 26.01.14	+24,060원	+1.76%
LG에너지솔루션	26.01.09 ~ 26.01.13	+225,266원	+6.21%
한화솔루션	26.01.09 ~ 26.01.13	+12,163원	+4.71%
두산에너지빌리티	26.01.09 ~ 26.01.13	+28,710원	+3.44%
현대차	26.01.09 ~ 26.01.09	+46,170원	+2.67%

일반 투자자

종목명	보유기간	실현손익	수익률
삼성전자	26.01.09 ~ 26.01.13	+66,778원	+2.74%
LG에너지솔루션	26.01.09 ~ 26.01.09	+12,498원	+1.15%
한화솔루션	26.01.09 ~ 26.01.13	+89,248원	+4.29%
두산에너지빌리티	26.01.13 ~ 26.01.13	-42,328원	-1.19%
현대차	26.01.13 ~ 26.01.13	+243,070원	+2.38%

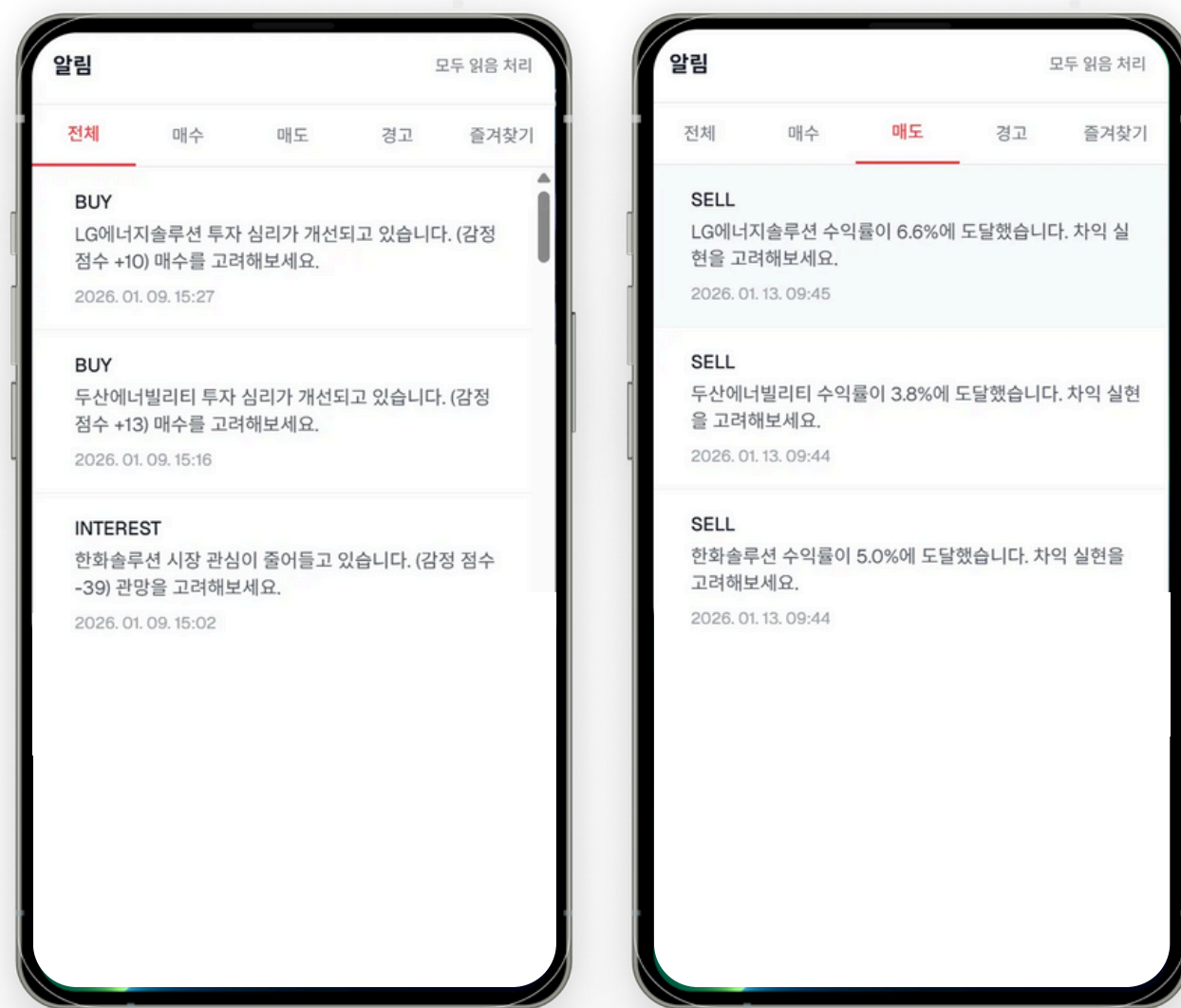
일반 투자자와 센티스톡 사용자의 투자 결과를 비교하였습니다.

그중에서도 **두산에너지빌리티**는 두 투자 방식의 차이가 가장 뚜렷하게 나타난 대표적인 사례였습니다.

일반 투자자의 경우 짧은 보유 기간 동안 변동성에 직접적으로 노출되어 **손실**로 거래를 마무리하였습니다.

반면 센티스톡 사용자는 뉴스 감정 분석을 기반으로 시장 이슈에 대한 긍정적인 감정 흐름이 유지되는 구간을 중심으로 보유 전략을 선택하였고, 그 결과 동일 종목임에도 불구하고 보다 **안정적인 수익**을 실현할 수 있었습니다.

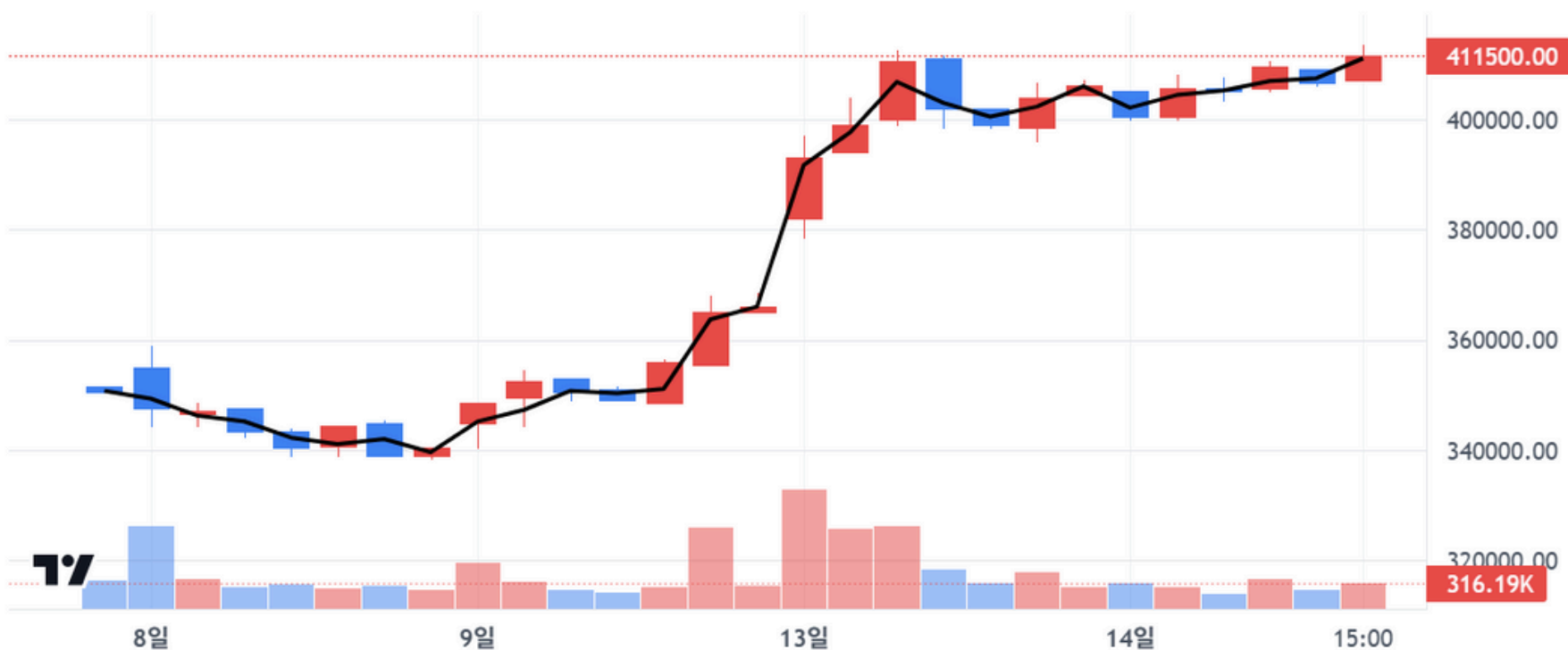
결과 및 관계분석



뉴스 기반 감정 점수가 급격히 변화하는 구간에서는
시장 변동성이 확대되고, 투자자의 감정적 매매가 증가하는 경향이 나타납니다.
SentiStock 알림은 이러한 흐름 속에서 감정 반응을 인식하게 하여
의사결정을 지연·조정하고 손실 구간 진입 가능성을 낮추는 역할을 합니다.

모의투자 실험 결과, 일반 투자자의 경우 뉴스 기반 감정 지표가 급격히 변동하는 시점에 시장 가격 변동성이 확대되면서 심리적 부담이 커지는 경향을 보였습니다. 이러한 상황에서는 단기적인 가격 움직임에 반응한 추격 매수나 성급한 매도와 같은 감정적 매매가 빈번하게 발생하였으며, 그 결과 상대적으로 불리한 가격 구간에서 거래가 이루어질 가능성이 높아지는 흐름이 관찰되었습니다.

캔들 차트 & 거래량



가격 차트와 감정 추세를 함께 분석한 결과, 감정 점수가 급격히 상승하거나 큰 폭으로 변동하는 구간에서는 **거래량 증가**와 함께 **단기적인 가격 변동성**이 강화되는 흐름이 관찰되었습니다. 이러한 구간에서 **일반 투자자는 가격 움직임에 즉각 반응하며 추격 매수나 지연된 매도**를 선택하는 경향을 보였고, 그 결과 변동성 확대 이후의 불리한 가격 구간에 진입하는 사례가 빈번하게 나타났습니다.

감정 추세 히스토리



반면, 본 모의투자에서는 **감정 점수의 급변, 평균선 상회 유지, 수익률 도달 시점 등을 의사결정 트리거로 설정**하여 매수·매도 판단에 개입하였습니다. 감정 지표가 과열 구간에 진입하거나 상승세가 둔화되는 시점에서는 신규 진입을 유보하거나 차익 실현을 고려하였으며, 감정 점수가 안정적으로 회복되는 구간에서는 제한적인 매수 판단을 수행하였습니다. 이러한 트리거 기반 의사결정은 **감정적 매매를 줄이고, 변동성 확대 이후 발생하는 손실 구간 진입을 회피**하는 방향으로 작용했으며, 그 결과 **일반 사용자 대비 보다 안정적인 수익 흐름을 확인할 수** 있었습니다.

분석 결과 요약

본 모의투자 실험을 통해 뉴스 기반 감정 지표는 개별 종목의 단기 수익을 직접적으로 예측하는 신호라기보다는, 시장 전반의 심리 상태와 변동성이 확대될 가능성이 높은 구간을 전에 인지하는 데 유의미한 보조 지표로 활용될 수 있음을 확인하였습니다.

특히 감정 점수가 급격히 변동하는 시점에서는 일반 투자자의 경우 단기 가격 움직임에 즉각 반응하는 경향이 나타났으며, 반면 감정 지표를 트리거로 활용한 경우에는 과열 구간에서의 신규 진입을 유보하거나 차익 실현을 고려하는 방향으로 의사결정 흐름이 달라지는 양상이 관찰되었습니다.

서비스 관점에서의 시사점

감정 데이터는 복잡한 재무 지표를 대체하기보다는, 투자자가 시장 환경을 직관적으로 인식할 수 있도록 돕는 '판단 보조 정보'로서의 역할에 적합합니다.

SentiStock은 감정 점수 변화와 수익 구간 도달을 의사결정 트리거로 제공함으로써 투자 판단을 자동화하지 않으면서도 감정적 매매를 완화하고 손실 가능성이 높은 구간을 회피할 수 있도록 지원하는 투자 보조 서비스로 확장 가능성을 시사합니다.



SENTISTOCK

모의투자 시뮬레이션



본 프레젠테이션에 대해 문의할 점이 있으시면 언제든지 문의주세요.



<https://sentistock.store>