# 젠포트 사용자매뉴얼 v1.5

NEWSY STOCK

# 시작하기

NEWSY STOCK

## ◎ 용어

- **젠포트** (Generator of Portfolio) 주식투자형 로보어드바이저 플랫폼 – 나만을 위한 '로보어드바이저'를 만들어 실제 투자에 활용
- **로보어드바이저** (Robo-Advisor) 로봇(Robot)과 투자전문가(Advisor)의 합성어
- **전략** 매수/매도/보유기간/매매 조건 등 사용자가 지정한 매매 기준
- **포트** 전략(알고리즘)을 통해 생성된 포트폴리오
- **백테스팅** 특정 기간 동안 사용자가 지정한 전략대로 과거 시뮬레이션 진행
- **젠트레이더** (GenTrader) 뉴지스탁에서 개발한 자동매매 프로그램 – 젠포트의 실전매매포트와 연동되어 계좌를 자동으로 관리
- **AWS** (Amazon Web Service) 아마존에서 제공하는 클라우드 서비스

## ◎ 젠포트 vs 시스템트레이딩

- **젠포트** 정해진 기간동안 매수/매도 반복 ▸ 과거와 미래 결과가 유사
- **시스템트레이딩** 시작일 매수한 종목을 종료일까지 보유 ▸ 과거와 미래 결과가 다름

## ◎ 메뉴

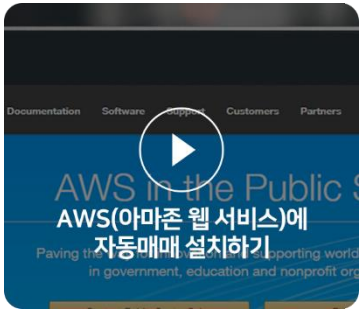
- **새 포트 만들기** — 나만의 전략을 알고리즘화 하여 검증하고 개선할 수 있음
- **젠마켓**(GenMarket) — 나의 전략을 공유하고, 타인이 공유한 검증된 전략을 복사, 수정할 수 있는 알고리즘 마켓
- **포트 관리하기** — 백테스팅 / 가상매매 / 실전매매 포트를 관리하고 매매정보를 확인할 수 있음
- **백테스팅 포트** — 과거 일정 기간동안 매매한 결과를 볼 수 있는 포트
  직접 만들거나 젠마켓에서 복사해 온 백테스팅 포트 리스트

  활용 : 추천종목을 통해 매일 전략에 맞는 종목 확인 가능
- **가상매매 포트** — 등록일부터 모의투자 형식으로 매매가 진행되고, 결과가 기록되는 포트
  등록한 다음 거래일부터 모의투자 진행, 실전투자 진행 전 한번 더 검증하는 단계
  매매종목 정보를 통해 매매할 종목/가격/비중 등을 장 전에 제공

  활용 : 매매종목을 따라서 매매할 경우 실전매매와 동일한 효과 발생
- **실전매매 포트** — 젠트레이더를 이용해 실제 계좌와 연동하여 자동으로 매매가 진행되고, 결과가 기록되는 포트
  등록한 다음 거래일부터 매매종목 정보를 이용한 실전투자 진행

  활용 : 검증을 마친 전략을 증권계좌와 연동하여 젠트레이더로 자동매매 실행

## ◎ 참고영상



- 젠트레이더(자동매매)는 개인 PC나 AWS 둘 중 하나에 설치하시면 됩니다.
- 2017년 12월 21일 이후 설치를 진행하시는 분들은 자동으로 **멀티 젠트레이더**가 설치됩니다.

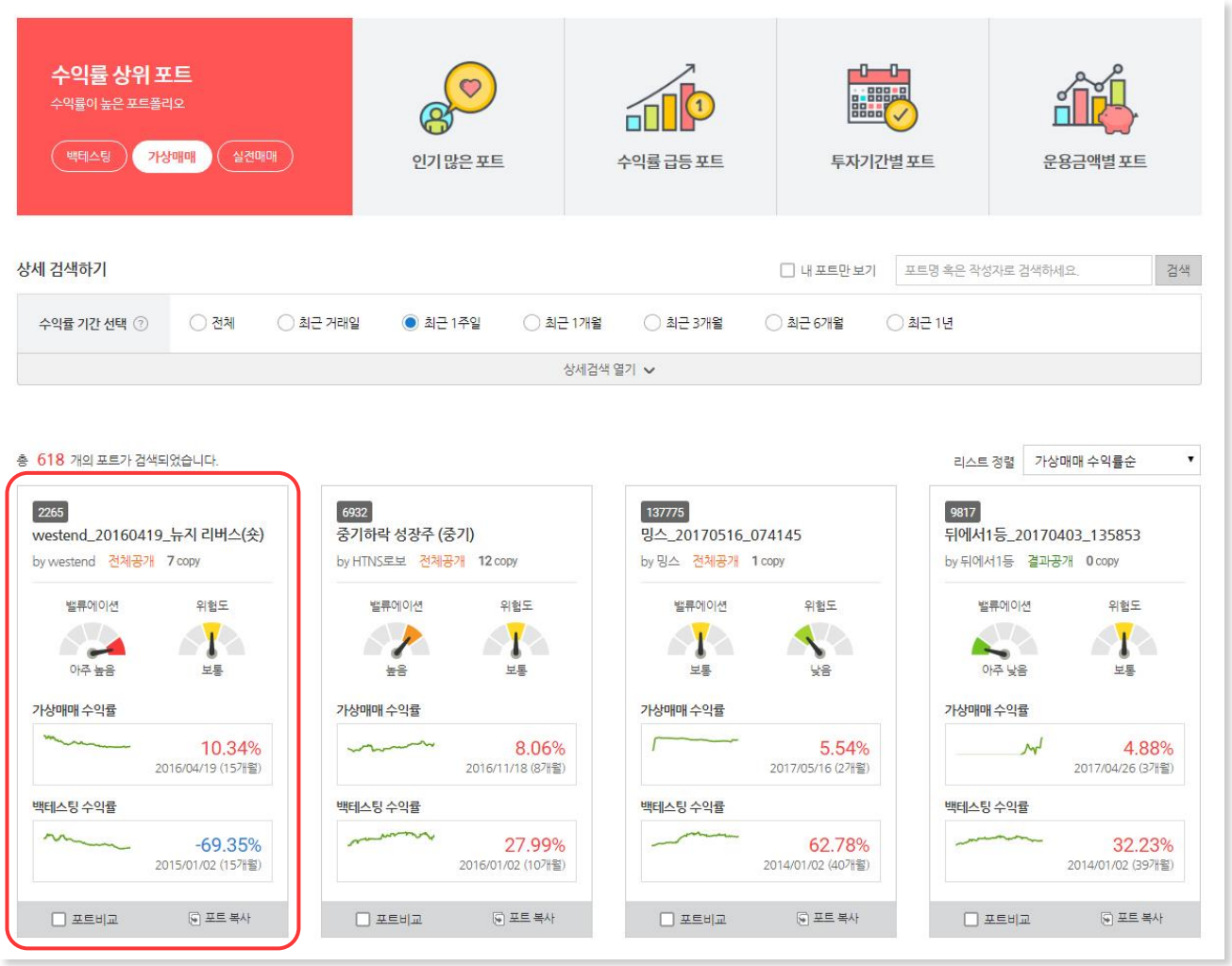
# 젠마켓

**나의 전략을 공유하고 타인의 전략을 복사할 수 있는 알고리즘 마켓**

- 직접 전략을 만들기 어려운 투자자들은 젠마켓에서 타인의 검증된 전략을 복사하여 사용 가능
- 타인의 전략을 참고하여 본인의 전략 고도화 가능
- 젠마트'(오픈예정)는 검증된 전략을 사고 팔 수 있는 시장

# 젠마켓 – 포트 검색





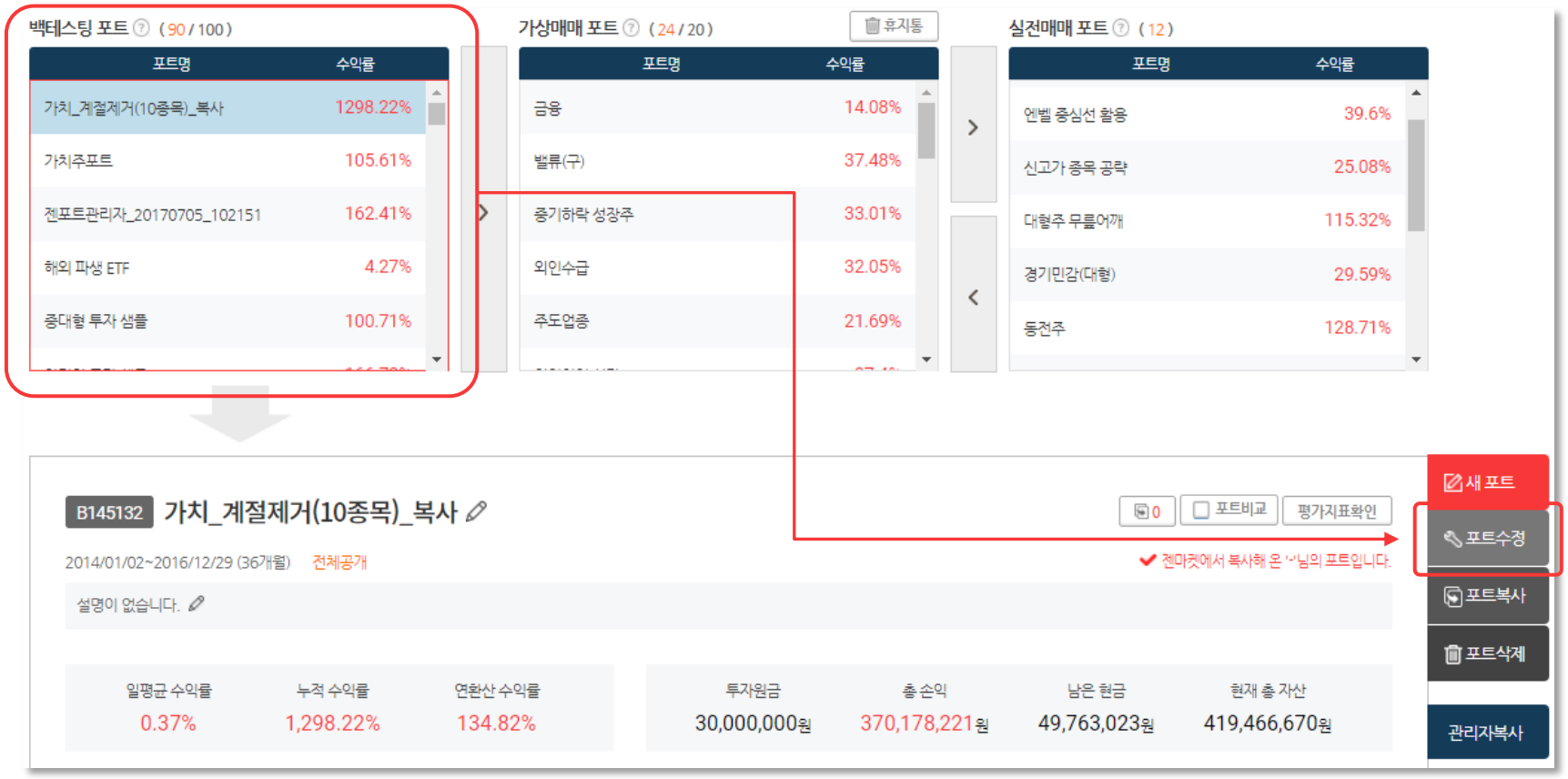

- 젠마켓에 공유된 전체 전략들의 수익률 확인 가능 (정렬 기준 변경 가능)

# 젠마켓 – 포트 복사

- 해당 포트의 상세한 수익률, 거래내역, 통계 등 확인 가능
- 포트복사를 누르면 나만의 포트 관리하기 화면으로 복사
- 포트복사 : 전체공개(전략 수정 가능), 결과공개(전략 수정 불가능)

# 젠마켓 – 포트 수정






- 복사해 온 전략은 '백테스팅 포트'에 자동 저장
- 전략 수정을 원할 경우 '포트수정'을 통해 수정 가능
- 결과공개(전략 미공개) 포트일 경우 젠마켓에서 복사는 가능하나 수정은 불가능

# 새 포트 만들기

**나만의 전략을 알고리즘화 해 검증 및 개선**

- 2010년 1월 이후 데이터를 활용하여 나만의 전략 백테스팅 가능
- 시장의 Raw Data 뿐만 아니라 점수, 등수 등의 가공된 팩터(조건)도 제공하기 때문에 초보자 부터 숙련자까지 쉽고 빠르게 '나만의 로보어드바이저' 생성 가능
- 자신의 투자성향에 맞는 전략을 만들어 그게 맞는 종목정보 획득 가능

# 1 새 포트 만들기 – 기본 설정

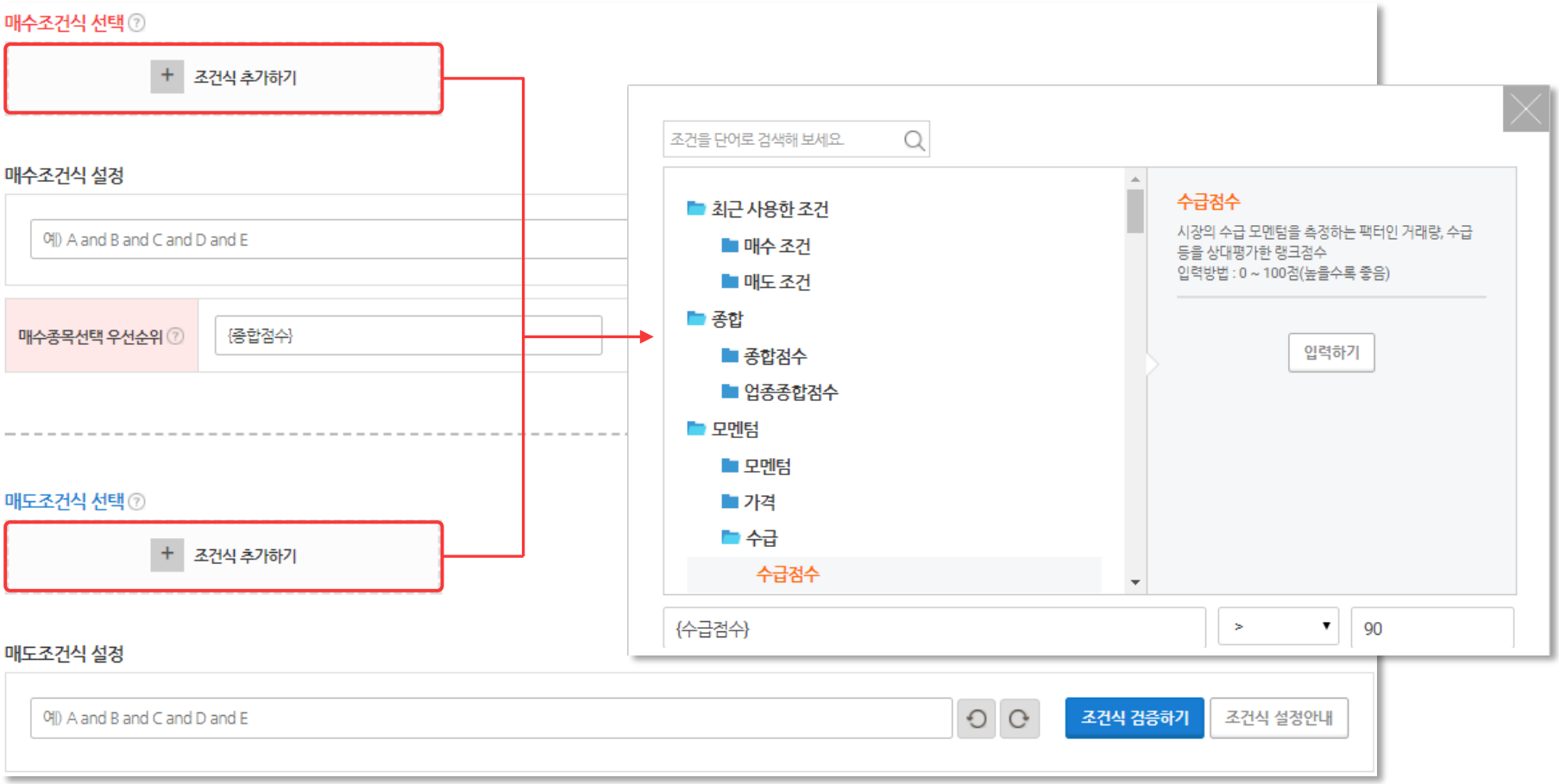
- 기본적인 매매 기준 설정 화면 (초보자일 경우 [ ] 부분만 변경)

# 2 새 포트 만들기 – 매매대상 설정

NEWSY STOCK

- **유니버스** : 시가총액을 기준으로 상장된 전 종목을 6개의 유니버스로 구분
- **ETF** : 개별주식 뿐만 아니라 ETF도 포함 가능

# 3 새 포트 만들기 – 매매조건 설정




- 점수/순위 등 가공된 데이터를 통해 쉽고 정확한 종목 필터링 가능
  (ex. 수급점수>90점 = 각 유니버스별 수급점수가 상위 10%인 종목을 선정)

- 가공되지 않은 Raw 데이터도 제공하여 좀 더 세밀한 종목 필터링 가능
- 총 300개 이상의 팩터(조건) 사용 가능

# 새 포트 만들기 – 포트 최적화



| 내가 입력한 조건 | | | | 최적화 조건 1 | 최적화 조건 2 |
|---|---|---|---|---|---|
| 매수조건 | 매수 가격기준 | 매수 가격기준 | 전일종가 0% | 전일종가 0 % | 전일종가 0 % |
| | 동일종목 매수조건 | 종목당 매수비중 | 10% | 20 % | 30 % |
| | | 종목당 최대 매수금액 | 제한없음 | 제한없음 만원 | 제한없음 만원 |
| | 매수 종목수 조건 | 최대 보유종목 수 | 10개 | 5 개 | 30 개 |
| | | 1일 최대 매수종목 수 | | | |
| | 매수종목 선택 우선순위 | 우선순위 조건 | | | |
| | | 정렬 | | | |

| 내 포트폴리오 평가 | | | | 최적화 조건 1 평가 | 최적화 조건 2 평가 |
|---|---|---|---|---|---|
| 평가지표별 수치 | 누적수익률 | | 261.11% | 237.60% | 167.38% |
| | 총 매매수 | > 30회 | 1,466 | 740 | 444 |
| | 승률 | > 30% | 53.00% | 52.30% | 54.95% |
| | 손익비 | > 1 | 1.63 | 1.52 | 1.52 |
| | 평균손익비 | > 1 | 1.40 | 1.35 | 1.22 |
| | 보상비율 | > 1 | 24.81 | 24.72 | 14.68 |
| | CPC Index | > 1.2 | 1.21 | 1.07 | 1.02 |
| | Sharp Ratio | 최대 | 1.12 | 1.50 | 1.70 |
| | 평균매매대상종목수 | | 176.14 | 176.22 | 176.24 |
| | | | 선택완료! | 이 포트 선택하기 | 이 포트 선택하기 |

- 조건 값들을 수정 후, 최적화 기능을 통해 최적의 조건 값을 확인 가능
- 최적화된 조건 값을 선택하여 최종 백테스팅 포트를 생성

# 5 새 포트 만들기 – 포트 완성!

- 완성된 전략은 '백테스팅 포트'에 자동 저장
- '포트수정'을 통해 전략을 수정할 수 있음
- 포트에 대한 정보, 설정조건(전략), 매매결과(통계), 수익률, 매매종목 정보, 거래내역 등 확인 가능
- 추천 종목에서는 매수조건에 성립하는 종목을 매일 최대 20개 까지 확인 가능

# 포트 관리하기

**백테스팅 / 가상매매 / 실전매매 포트를 관리**

- 매수조건에 성립하는 종목을 매일추천
- 실제 내 계좌에서 매수 / 매도할 종목을 매일 제공하며, 젠트레이더(자동매매 프로그램)가 자동관리
- PC와 Mobile환경 모두 지원

# 1 포트 관리하기 – 포트 목록

**❶ 백테스팅 포트**

과거 일정 기간동안 매매한 결과를 볼 수 있는 포트
직접 만들거나 젠마켓에서 복사해 온 백테스팅 포트 리스트

활용 : 추천종목을 통해 매일 전략에 맞는 종목 확인 가능

**❷ 가상매매 포트**

등록일부터 모의투자 형식으로 매매가 진행되고, 결과가 기록되는 포트
등록한 다음 거래일부터 모의투자 진행, 실전투자 진행 전 한번 더 검증하는 단계
매매종목 정보를 통해 매매할 종목/가격/비중 등을 장 전에 제공

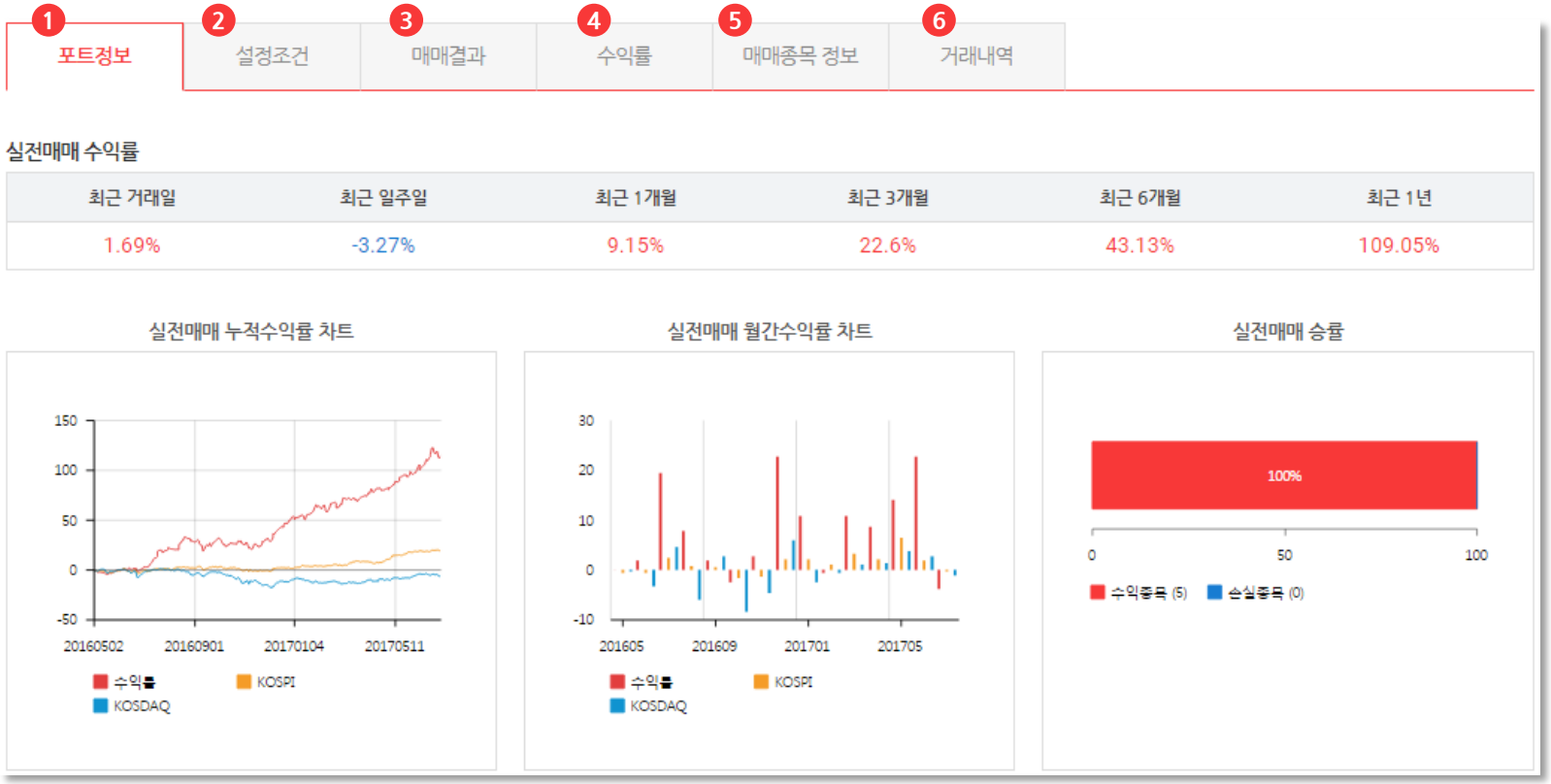
활용 : 매매종목을 따라서 매매할 경우 실전매매와 동일한 효과 발생

**❸ 실전매매 포트**

젠트레이더를 이용해 실제 계좌와 연동하여 자동으로 매매가 진행되고, 결과가 기록되는 포트
등록한 다음 거래일부터 매매종목 정보를 이용한 실전투자 진행

활용 : 검증을 마친 전략을 증권계좌와 연동하여 젠트레이더로 자동매매 실행

# 2 포트 관리하기 – 포트 상세 분석




**1 포트정보** 백테스팅/가상매매/실전매매 포트에 대한 수익률 및 승률 정보

**2 설정조건** 매수/매도 조건

**3 매매결과** 통계

**4 수익률** 기간 누적 수익률, 차트, 매도종목 수익률 확인 가능

**5 매매종목 정보** 추천종목
(매수조건에 성립하는 종목 매일 최대 20개 제공)
보유종목 (현재 보유 중인 종목)
매수종목 (실제 매수할 종목)
매도종목 (실제 매도할 종목)

**6 거래내역** 운용기간 동안 매매를 했던 거래내역 확인 가능

# 젠트레이더

**뉴지스탁에서 자체 개발한 포트폴리오 자동매매 프로그램**

- 젠포트 실전매매 포트와 연동되어 실제 계좌를 자동으로 관리

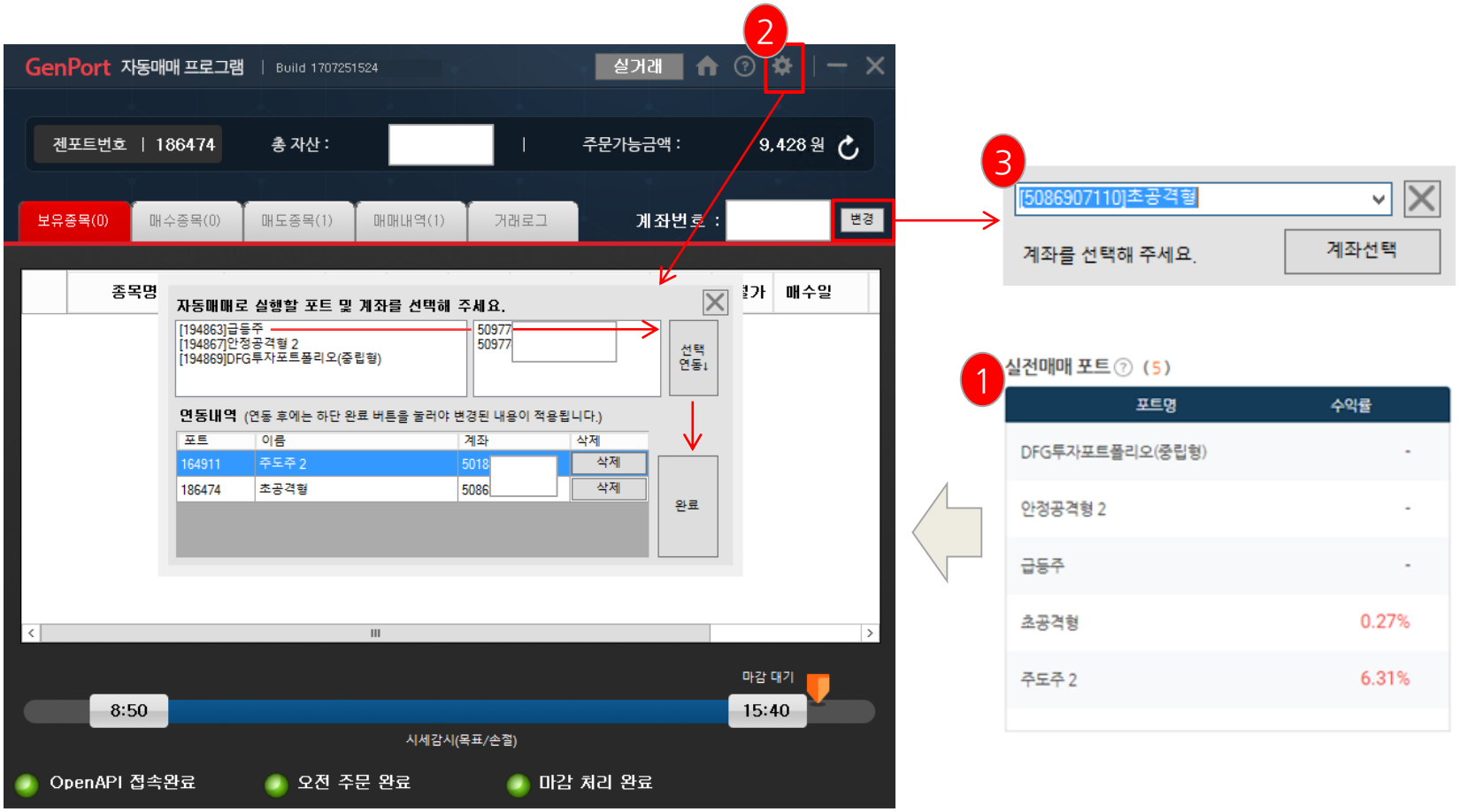
NEWSY STOCK

| | |
|---|---|
| **프로그램 다운로드** | 젠트레이더 다운로드 |
| **매뉴얼 다운로드** | 젠트레이더 설치 및 실행 방법 (확인 필수) |
| **설치/실행 위치** | PC (설치 쉬움, 본인 PC에서만 실행 가능) |
| | AWS (설치 어려움 , PC/Mobile 어디서든 실행 가능) |

**설치 도움** 설치 및 실행에 어려움이 있을 경우 아래 경로로 연락

카카오톡 : @뉴지스탁
e-mail : info@newsystock.com
Office : 1899-0955

# 2 젠트레이더 - 다수의 계좌 동시에 운영하기

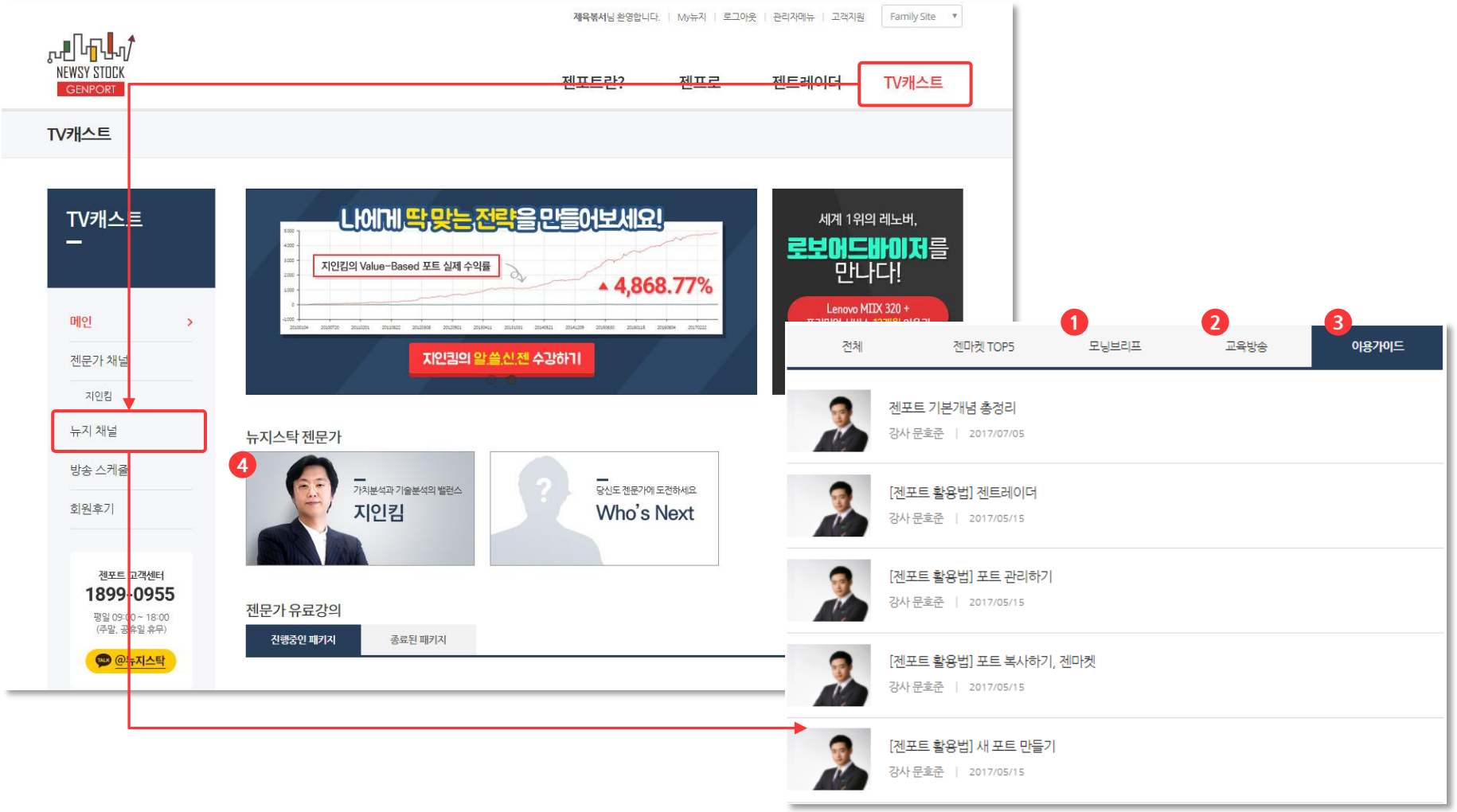



1. 포트관리하기 화면에서 실전매매 포트를 최대 5개까지 등록할 수 있습니다.
2. 자동매매로 실행할 포트 및 계좌를 선택할 수 있습니다.
3. 보고 싶은 계좌를 선택할 수 있습니다.

# TV캐스트

뉴지스탁에서 제공하는 모든 방송 시청 가능

# 1 TV캐스트




❶ **모닝브리프** 매일 아침 무료 시황 방송 제공

❷ **교육방송** 젠포트 활용방법 및 시장에 맞는 전략 생성 정보 제공

❸ **이용가이드** 젠포트 기본개념 녹화방송 (필수 시청)

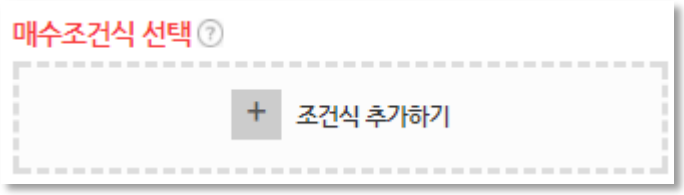
❹ **젠문가** 젠포트 활용도를 높여줄 강의, 컨설팅 등을 제공하는 젠포트 전문가의 프리미엄 서비스

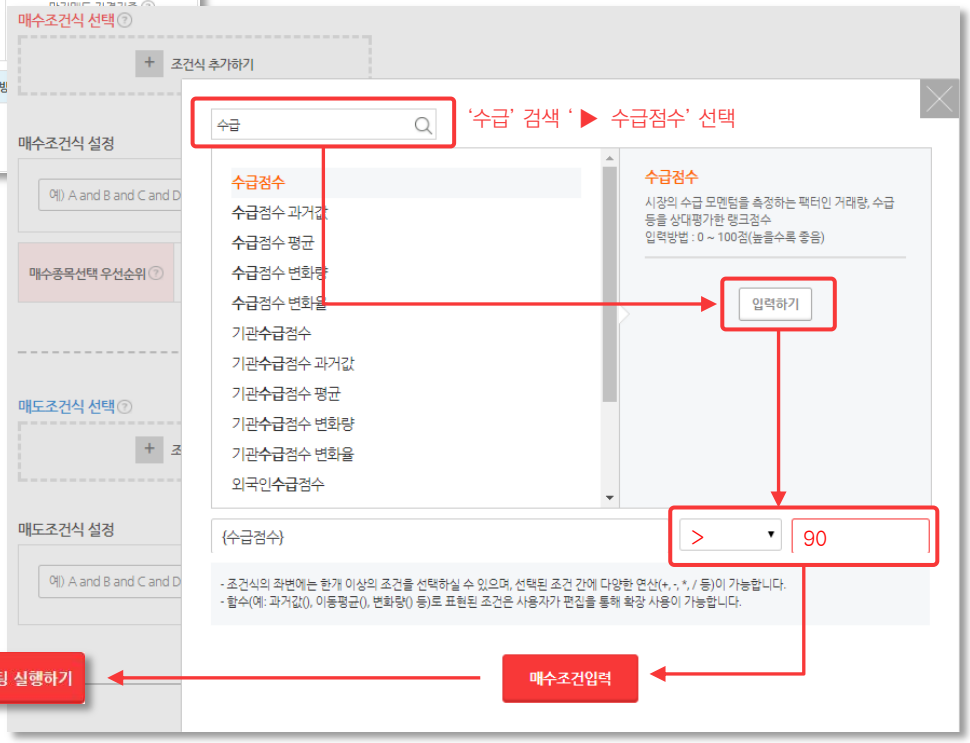
# 샘플 포트 만들기

‘새 포트 만들기 ' 에서 [ ] 부분만 설정하면
나만의 로보어드바이저 탄생!

# 1 샘플 포트 – 수급강세 포트폴리오

NEWSY STOCK




❗ 매도로직에 (수급점수 < 10) 을 넣어주면
수익률이 더 좋아집니다!

# 2 샘플 포트 – 가치주 포트폴리오

목표가 : 20%  손절가 : 15%

종목 최대 보유일 : 22일

1일 최대 매매종목 수 : 5종목

PER, PBR, ROE, 가치, 성장점수와 PER팩터를 직접 넣어보세요!

시가총액 오름차순 = 시가총액 낮은 순으로 매수

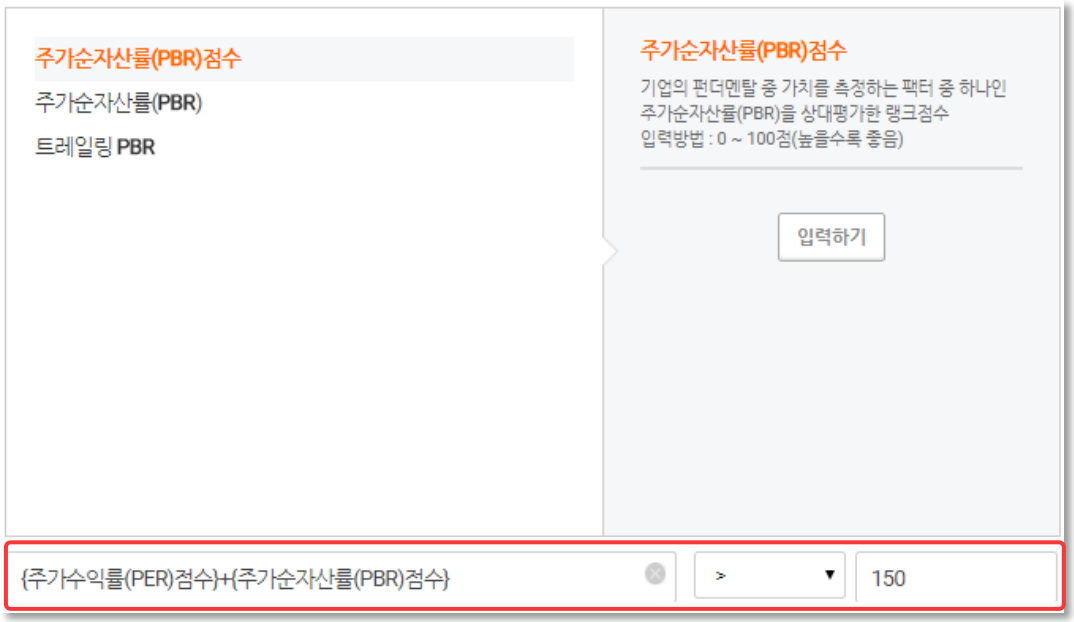
# 3 샘플 포트 – 가치주 포트폴리오 (퀀트 기반의 월 단위 리밸런싱)

NEWSY STOCK

목표가 / 손절가 : 999%(무제한)

종목 최대 보유일 : 20일
만기매도 가격기준 : 시초가

종목당 매수비중 : 3%
최대 보유종목 수 : 30종목




PER점수 + PBR점수 〉 150

***Newsystock Co., Ltd***

Three IFC 19F,
10, Gukjegeumyung-ro, Yeongdeungpo-gu,
Seoul, 07326, Rep. of KOREA

www.newsystock.com

**Copyright ⓒ 2015 by Newsystock Co., Ltd.**
This report is solely for the use of client personnel. No part of it may be circulated, quoted, or reproduced for distribution outside the client organization without prio r written approval from Newsystock Co., Ltd. This document provides an outline of a presentation and is incomplete without the accompanying oral commentary and discussion. Newsystock Co., Ltd. is an associated firm, operating independently under the Newsystock Co., Ltd. name.