

젠포트 사용자매뉴얼 v1.5





시작하기

◎ 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

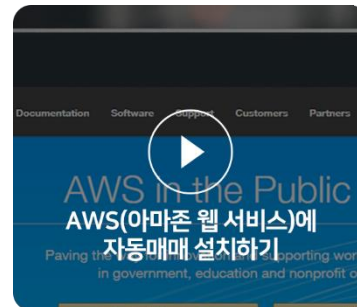
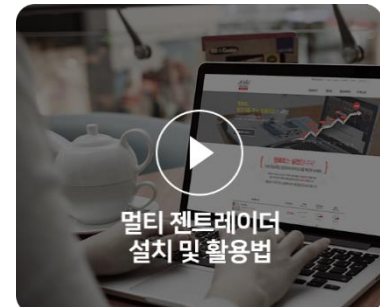
◎ 젠포트 vs 시스템트레이딩

- **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 설치**하시면 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

수익률 상위 포트
수익률이 높은 포트폴리오

백테스팅
가상매매
실전매매



인기 많은 포트



수익률 급등 포트



투자기간별 포트



운영금액별 포트

상세 검색하기 ☐ 내 포트만 보기

포트명 혹은 작성자로 검색하세요. 검색

수익률 기간 선택 ?

☐ 전체
 ☐ 최근 거래일
 ☒ 최근 1주일
 ☐ 최근 1개월
 ☐ 최근 3개월
 ☐ 최근 6개월
 ☐ 최근 1년

상세검색 열기 v

총 618 개의 포트가 검색되었습니다.

리스트 정렬 가상매매 수익률순 v

2265
westend_20160419_뉴지 리버스(웃)

by westend 전체공개 7 copy

발류에이션



아주 높음

위험도



보통

가상매매 수익률



10.34%

2016/04/19 (8개월)

백테스팅 수익률



-69.35%

2015/01/02 (15개월)

☐ 포트비교
 ☒ 포트 복사

6932
중기하락 성장주 (중기)

by HTNS로보 전체공개 12 copy

발류에이션



높음

위험도



보통

가상매매 수익률



8.06%

2016/11/18 (8개월)

백테스팅 수익률



27.99%

2016/01/02 (10개월)

☐ 포트비교
 ☒ 포트 복사

137775
밍스_20170516_074145

by 밍스 전체공개 1 copy

발류에이션



보통

위험도



낮음

가상매매 수익률



5.54%

2017/05/16 (2개월)

백테스팅 수익률



62.78%

2014/01/02 (40개월)

☐ 포트비교
 ☒ 포트 복사

9817
뒤에서1등_20170403_135853

by 뒤에서1등 결과공개 0 copy

발류에이션



아주 낮음

위험도



보통

가상매매 수익률



4.88%

2017/04/26 (3개월)

백테스팅 수익률



32.23%

2014/01/02 (39개월)

☐ 포트비교
 ☒ 포트 복사

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

젠마켓

V138829 가치_계절제거(10종목)_복사

by 증권사 2017/05/31~2017/07/05 (1개월) 전체공개 전략이 마음에 들 경우 복사 가능

설명이 없습니다.

일평균 수익률	누적 수익률	연환산 수익률	투자원금	총 손익	남은 현금	현재 총 자산
0.81%	21.55%	294.77%	30,000,000원	5,972,599원	597,725원	36,464,630원

포트정보 | 설정조건 | 매매결과 | 수익률 | 매매종목 정보 | 거래내역

가상매매 수익률

최근 거래일	최근 일주일	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
1.21%	8.06%	22.5%	21.55%	21.55%	21.55%

가상매매 누적수익률 차트

가상매매 월간수익률 차트

가상매매 승률

수익률 36%, 손실률 64%

백테스팅 수익률

- 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)

백테스팅 포트 (90 / 100)

포트명	수익률
가치_계절제거(10종목)_복사	1298.22%
가치주포트	105.61%
젠포트관리자_20170705_102151	162.41%
해외 파생 ETF	4.27%
종대형 투자 샘플	100.71%

가상매매 포트 (24 / 20)

휴지통

포트명	수익률
금융	14.08%
발류(구)	37.48%
증기하락 성장주	33.01%
외인수급	32.05%
주도업종	21.69%

실전매매 포트 (12)

포트명	수익률
엔벨 중심선 활용	39.6%
신고가 종목 공략	25.08%
대형주 무릎어깨	115.32%
경기민감(대형)	29.59%
동전주	128.71%

B145132 가치_계절제거(10종목)_복사

0

포트비교

평가지표확인

새 포트

포트수정

포트복사

포트삭제

관리자복사

2014/01/02~2016/12/29 (36개월) 전체공개

✓ 전마켓에서 복사해 온 '나'님의 포트입니다.

설명이 없습니다.

일평균 수익률	누적 수익률	연환산 수익률	투자원금	총 손익	남은 현금	현재 총 자산
0.37%	1,298.22%	134.82%	30,000,000원	370,178,221원	49,763,023원	419,466,670원

- 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 전략**을 만들어 그게 맞는 종목정보 획득 가능

포트 제목

수급 강세 종목 투자

포트 설명 (선택사항)

수급이 강한 종목 투자

기본 조건

운용자금 ?

5,000 만원

실제 운용할 자금

운용기간 ?

2014/01/02

부터

2017/07/05

까지

상한기준 30% 변동일(2015/06/15) 기준

이전

이후

2010년 1월 이후부터 전일까지 백테스팅 가능

수수료율 ?

0.100 %

실제 매매 수수료

슬리피지 ?

0.000 %

매수조건

매수 가격기준 ?

전일종가 +0.0 %

종목별 매수조건

종목당 매수비중 ?

10 %

종목당 전체 자산 대비 10% 비중으로 매수

종목당 최대 매수금액 ?

제한없음 만원

매수 종목수 조건

최대 보유종목 수 ?

10 종목

최대 10종목 매수

1일 최대 매매종목 수 ?

제한없음 종목

필터링 조건 ?

관리종목

☒ 제외
☐ 포함

감리종목

☒ 제외
☐ 포함

※ 매수조건 우선순위

종목당 매수비중 > 최대 보유종목 개수 > 종목당 최대 매수금액 > 1일 최대 매수종목 수

매도조건

퇴출(stop) 조건 ?

목표가

매수가의 + 10.0 %

손절가

매수가의 - 10.0 %

보유일 관련 조건

종목 최소 보유일 ?

0 일

종목 최대 보유일 ?

5 일

만기매도 가격기준 ?

전일종가 +0.0 %

매도조건 부합시 매도방법

조건 부합시 매도 가격기준 ?

전일종가 +0.0 %

트레이딩스타일 ?

☐ 사용할
☒ 사용안함

※ 매도조건 우선순위

종목 최소 보유일 매도 > 매도조건 부합시 매도 > 종목 최대 보유일 매도 > 손절가 매도 > 목표가 매도

- 기본적인 매매 기준 설정 화면 (초보자일 경우 부분만 변경)

유니버스/업종, 테마, 관심종목 중 한 가지 그룹을 선택하여 매매대상을 설정하실 수 있습니다.

☒ 유니버스/업종 ?

☐ 테마 ?

☐ 관심종목 ?

유니버스 선택

전체선택

선택해제

☒ 코스피 중대형 ☒ 코스피 중소형 ☒ 코스닥 대형 ☒ 코스닥 중형 ☒ 코스닥 소형 ☒ 코스닥 초소형 ☐ ETF

업종 선택

전체선택

선택해제

에너지 | ☒ 석유와 가스

소재 | ☒ 철강 ☒ 종이 / 목재 ☒ 사료 ☒ 비철금속 ☒ 화학
☒ 농업 / 비료 ☒ 강관업체 ☒ 건축자재 ☒ 포장재

산업재 | ☒ 조선 / 해운 ☒ 운수창고 / 운송 ☒ 건설 ☒ 항공 ☒ 환경
☒ 철도 ☒ 공작기계 ☒ 재난 / 안전 ☒ 유통 ☒ 전기장비
☒ 방산 / 우주항공

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

매수조건식 선택 ⑦

+ 조건식 추가하기

매수조건식 설정

예) A and B and C and D and E

매수종목선택 우선순위 ⑦ {종합점수}

매도조건식 선택 ⑦

+ 조건식 추가하기

매도조건식 설정

예) A and B and C and D and E

조건식 검증하기 조건식 설정안내

조건을 단어로 검색해 보세요

최근 사용한 조건

매수 조건

매도 조건

종합

종합점수

업종종합점수

모멘텀

모멘텀

가격

수급

수급점수

수급점수

시장의 수급 모멘텀을 측정하는 팩터인 거래량, 수급 등을 상대평가한 랭크점수

입력방법 : 0 ~ 100점(높을수록 좋음)

입력하기

{수급점수} > 90

- 점수/순위 등 가공된 데이터를 통해 쉽고 정확한 종목 필터링 가능
(ex. 수급점수)90점 = 각 유니버설 수급점수가 상위 10%인 종목을 선정)
- 가공되지 않은 Raw 데이터도 제공하여 좀 더 세밀한 종목 필터링 가능
- 총 300개 이상의 팩터(조건) 사용 가능

내가 입력한 조건			최적화 조건 1		최적화 조건 2	
매수조건	매수 가격기준	매수 가격기준	전일증가 0%	전일증가 <input type="text" value="0"/> %	전일증가 <input type="text" value="0"/> %	
	동일종목 매수조건	종목당 매수비중	10%	<input type="text" value="20"/> %	<input type="text" value="30"/> %	
		종목당 최대 매수금액	제한없음	<input type="text" value="제한없음"/> 만원	<input type="text" value="제한없음"/> 만원	
	매수 종목수 조건	최대 보유종목 수	10개	<input type="text" value="5"/> 개	<input type="text" value="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 ⑦		261.11%	237.60%	167.38%	
	총 매매수 ⑦	> 30회	1,466	740	444	
	승률 ⑦	> 30%	53.00%	52.30%	54.95%	
	손익비 ⑦	> 1	1.63	1.52	1.52	
	평균손익비 ⑦	> 1	1.40	1.35	1.22	
	보상비율 ⑦	> 1	24.81	24.72	14.68	
	CPC Index ⑦	> 1.2	1.21	1.07	1.02	
	Sharp Ratio ⑦	최대	1.12	1.50	1.70	
	평균매매대상종목수 ⑦		176.14	176.22	176.24	

선택완료!
이 포트 선택하기
이 포트 선택하기

- 조건 값들을 수정 후, 최적화 기능을 통해 **최적의 조건 값**을 확인 가능
- 최적화된 조건 값을 선택하여 **최종 백테스팅 포트**를 생성



- 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, **젠티레이더(자동매매 프로그램)**가 자동관리
- **PC와 Mobile**환경 모두 지원

백테스팅 포트 ? (91 / 100)

포트명	수익률
수급 강세 증목 투자	261.11%
가치_계절제거(10종목)_복사	1298.22%
가치주포트	105.61%
젠포트관리자_20170705_102151	162.41%
해외 파생 ETF	4.27%

가상매매 포트 ? (24 / 20)

포트명	수익률
금융	14.08%
밸류(구)	37.48%
중기하락 성장주	33.01%
외인수급	32.05%
주도업종	21.69%

휴지통

실전매매 포트 ? (12)

포트명	수익률
엔벨 중심선 활용	39.6%
신고가 증목 공략	25.08%
대형주 무릎어깨	115.32%
경기민감(대형)	29.59%
동전주	128.71%

- ① 백테스팅 포트 과거 일정 기간동안 매매한 결과를 볼 수 있는 포트
직접 만들거나 젠마켓에서 복사해 온 백테스팅 포트 리스트

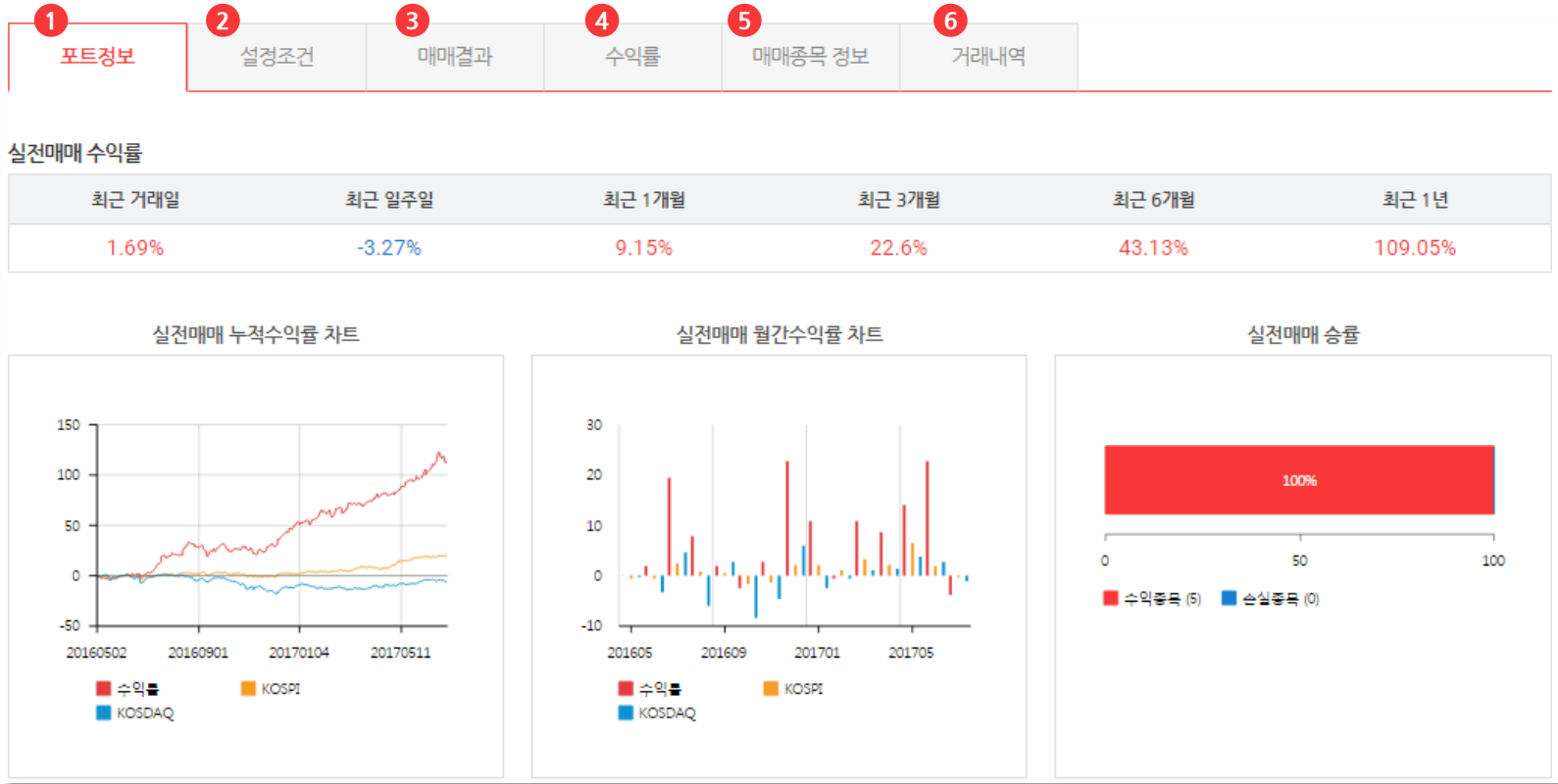
활용 : 추천종목을 통해 매일 전략에 맞는 종목 확인 가능

- ② 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

- ③ 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



- 1 포트정보

2 설정조건

3 매매결과

4 수익률
- 5 매매종목 정보

6 거래내역
- 백테스팅/가상매매/실전매매 포트에 대한 수익률 및 승률 정보

매수/매도 조건

통계

기간 누적 수익률, 차트, 매도종목 수익률 확인 가능
- 추천종목
(매수조건에 성립하는 종목 매일 최대 20개 제공)
보유종목 (현재 보유 중인 종목)
매수종목 (실제 매수할 종목)
매도종목 (실제 매도할 종목)

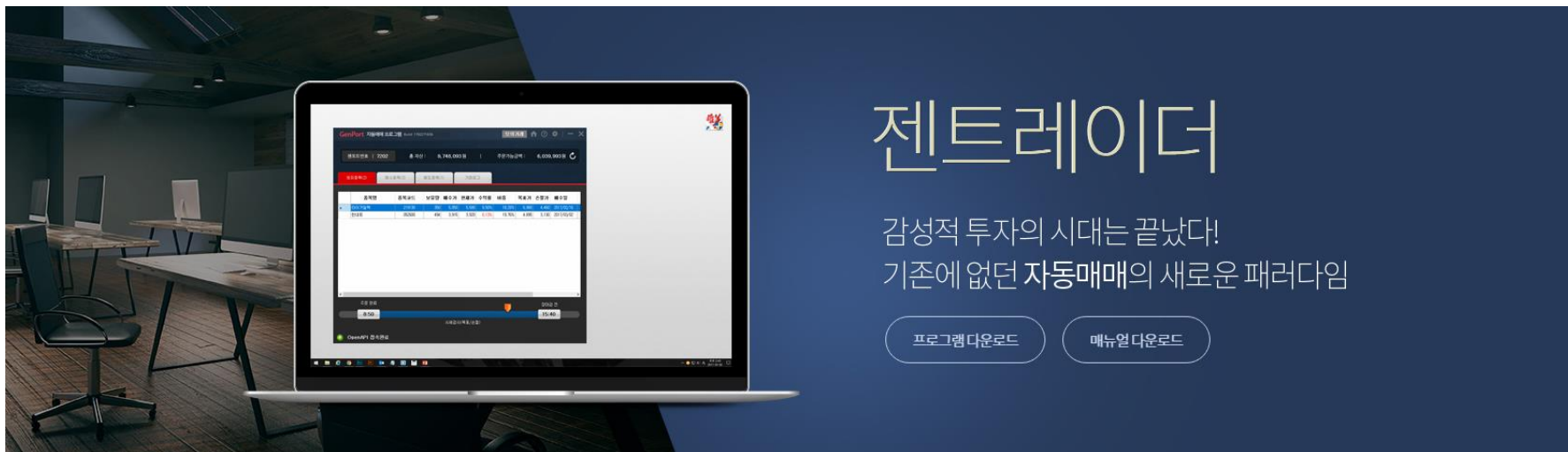
운용기간 동안 매매를 했던 거래내역 확인 가능



젠티레이더

뉴지스탁에서 자체 개발한 포트폴리오 자동매매 프로그램

- 젠티포트 실전매매 포트와 연동되어 실제 계좌를 자동으로 관리



젠티레이더

감성적 투자의 시대는 끝났다!
기존에 없던 자동매매의 새로운 패러다임

프로그램 다운로드

매뉴얼 다운로드

프로그램 다운로드

젠티레이더 다운로드

매뉴얼 다운로드

젠티레이더 설치 및 실행 방법 (확인 필수)

설치/실행 위치

PC (설치 쉬움, 본인 PC에서만 실행 가능)

AWS (설치 어려움, PC/Mobile 어디서든 실행 가능)

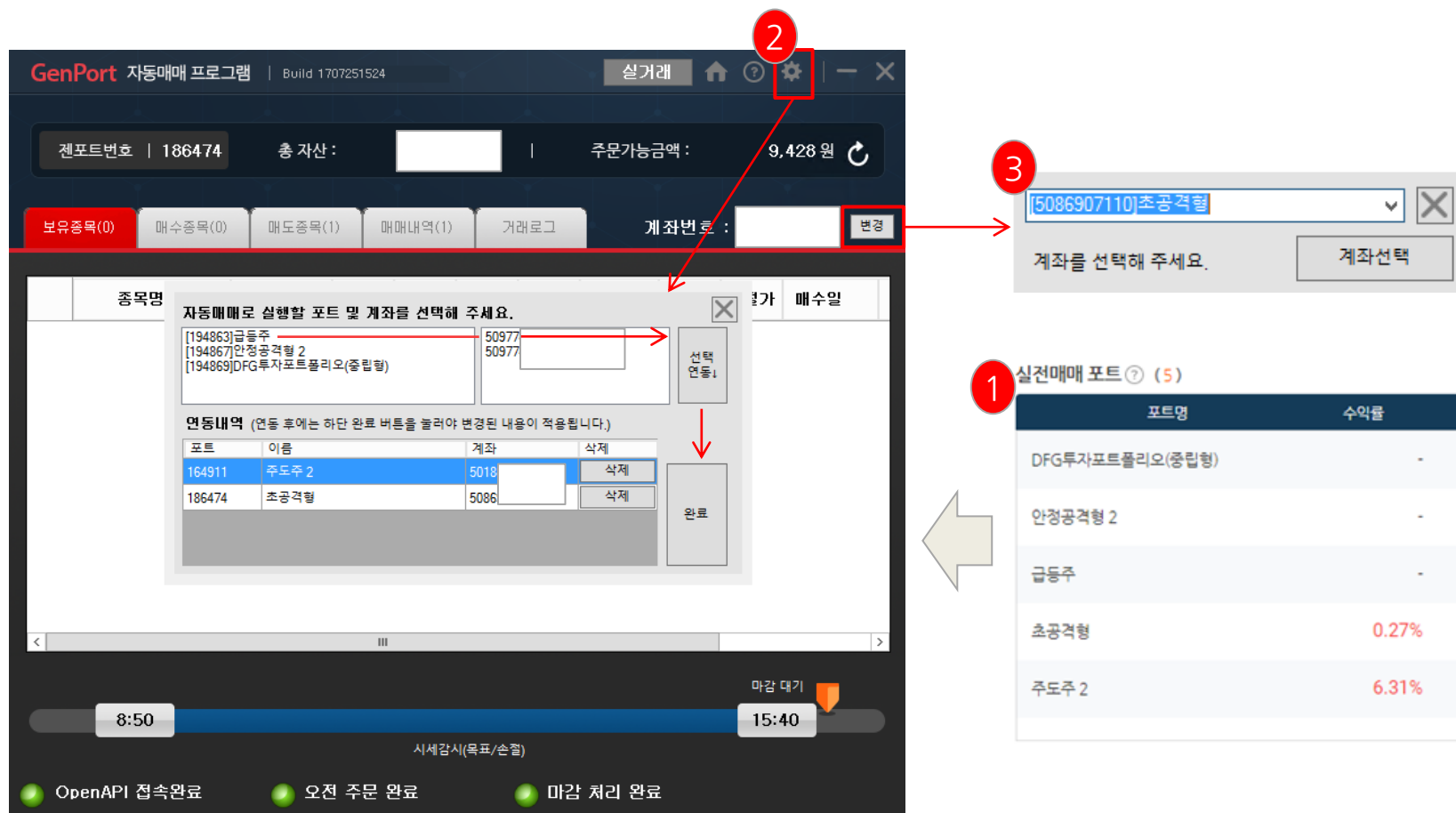
설치 도움

설치 및 실행에 어려움이 있을 경우 아래 경로로 연락

카카오톡 : @뉴지스탁

e-mail : info@newsystock.com

Office : 1899-0955



GenPort 자동매매 프로그램 | Build 1707251524

실거래

젠포트번호 | 186474 | 총 자산 : | 주문가능금액 : 9,428 원

보유종목(0) | 매수종목(0) | 매도종목(1) | 매매내역(1) | 거래로그

계좌번호 : | 변경

종목명 | 자동매매로 실행할 포트 및 계좌를 선택해 주세요.

[194863]급등주 | 50977
[194867]안정공격형 2 | 50977
[194869]DFG투자포트폴리오(중립형)

연동내역 (연동 후에는 하단 완료 버튼을 눌러야 변경된 내용이 적용됩니다.)

포트	이름	계좌	삭제
164911	주도주 2	5018	삭제
186474	초공격형	5086	삭제

완료

3 [5086907110]초공격형

계좌를 선택해 주세요. | 계좌선택

1 실전매매 포트 (5)

포트명	수익률
DFG투자포트폴리오(중립형)	-
안정공격형 2	-
급등주	-
초공격형	0.27%
주도주 2	6.31%

8:50 | 15:40

시세감시(목표/손절)

OpenAPI 접속완료 | 오전 주문 완료 | 마감 처리 완료

- 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



The screenshot shows the Newsy Stock TV Cast website. At the top, there's a navigation bar with links like '재무분석' (Financial Analysis), 'My뉴지', '로그아웃', '관리자메뉴', '고객지원', and a 'Family Site' dropdown. Below this is a 'TV캐스트' (TV Cast) section. On the left, a sidebar menu includes '메인', '전문가 채널', '지인킴', '뉴지 채널', '방송 스케줄', and '회원후기'. The main content area features a large chart titled '나에게 딱맞는 전략을 만들어보세요!' (Create a strategy that fits you!) showing a line graph with a red arrow pointing to a peak labeled '지인킴의 Value-Based 포트 실제 수익률' (Actual return rate of Geon Kim's Value-Based Portfolio) with a value of 4,868.77%. Below the chart is a button '지인킴의 알쓸신전 수강하기' (Take Geon Kim's All-Star Strategy Course). To the right, there's a section for '세계 1위의 레노버, 로보어드바이저를 만나다!' (Meet the world's #1 Lenovo, Robo-Advisor) featuring a Lenovo MIX 320 + advertisement. At the bottom, there's a navigation bar with tabs: '전체', '젠마켓 TOP5', '모닝브리프', '교육방송', and '이용가이드'. The '모닝브리프' tab is selected and highlighted with a red circle 1. The '교육방송' tab is highlighted with a red circle 2. The '이용가이드' tab is highlighted with a red circle 3. Below the tabs, there's a list of programs with a red circle 4 pointing to the 'Who's Next' section. The list includes: '젠포트 기본개념 총정리' (Geonport Basic Concepts Summary) by 강사 문호준 (2017/07/05), '[젠포트 활용법] 젠트레이더' (Geonport Usage Method: Geon Trader) by 강사 문호준 (2017/05/15), '[젠포트 활용법] 포트 관리하기' (Geonport Usage Method: Portfolio Management) by 강사 문호준 (2017/05/15), '[젠포트 활용법] 포트 복사하기, 젠마켓' (Geonport Usage Method: Portfolio Copying, Geon Market) by 강사 문호준 (2017/05/15), and '[젠포트 활용법] 새 포트 만들기' (Geonport Usage Method: Create New Portfolio) by 강사 문호준 (2017/05/15). The 'Who's Next' section features a profile of 지인킴 (Geon Kim) with the text '당신도 전문가에 도전하세요' (You can also challenge yourself as an expert) and 'Who's Next'.

① 모닝브리프 매일 아침 무료 시황 방송 제공

② 교육방송 젠포트 활용방법 및 시장에 맞는 전략 생성 정보 제공

③ 이용가이드 젠포트 기본개념 녹화방송 (필수 시청)

④ 전문가 젠포트 활용도를 높여줄 강의, 컨설팅 등을 제공하는 젠포트 전문가의 프리미엄 서비스



샘플 포트 만들기

'새 포트 만들기' 에서  부분만 설정하면
나만의 로보어드바이저 탄생!

포트 제목
수급유입 종목

포트 설명 (선택사항)
포트폴리오에 대한 설명을 100자 이내로 남겨주세요.

기본 조건

운용자금 5,000 만원	운용기간 2014/01/02 부터 2017/07/05 까지 상한기준 30% 변동일(2015/06/15) 기준 이전 이후	수수료율 0.100 %	슬리피지 0.000 %
-------------------------	---	------------------------	------------------------

매수조건

매수 가격기준
전일종가 +0.0 %

종목별 매수조건

종목당 매수비중 10 %	종목당 최대 매수금액 제한없음 만원
------------------	------------------------

매수 종목수 조건

최대 보유종목 수 10 종목	1일 최대 매매종목 수 제한없음 종목
--------------------	-------------------------

매도조건 목표가 : 20% 손절가 : 15%

매도(stop) 조건

목표가 매수가의 + 20 %	손절가 매수가의 - 15 %
--------------------	--------------------

보유일 관련 조건

종목 최소 보유일 0 일	종목 최대 보유일 5 일
------------------	------------------

매도조건 부합시 매도기준

조건 부합시 매도 가격기준 전일종가 +0.0 %

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

매수조건식 선택 ?

+ 조건식 추가하기

매수조건식 선택

+ 조건식 추가하기

수급

수급점수

수급점수 과거값
수급점수 평균
수급점수 변화량
수급점수 변화율
기관수급점수
기관수급점수 과거값
기관수급점수 평균
기관수급점수 변화량
기관수급점수 변화율
외국인수급점수

수급점수
시장의 수급 모멘텀을 측정하는 핵심인 거래량, 수급 등을 상대평가한 링크점수
입력방법 : 0 ~ 100점(높을수록 좋음)

입력하기

(수급점수) > 90

조건식의 좌변에는 한개 이상의 조건을 선택하실 수 있으며, 선택된 조건 간에 다양한 연산(+, -, *, / 등)이 가능합니다.
합수(예: 과거값(), 이동평균(), 변화량() 등)로 표현된 조건은 사용자가 편집을 통해 확장 사용이 가능합니다.

백테스팅 실행하기

매수조건입력

포트 제목

수급유입 종목

포트 설명 (선택사항)

포트폴리오에 대한 설명을 100자 이내로 남겨주세요.

기본 조건

운용자금

5,000 만원

운용기간

2014/01/02 부터 2017/07/05 까지

상한기준 30% 변동일(2015/06/15) 기준 이전 이후

수수료율

0.100 %

슬리피지

0.000 %

매수조건

매수 가격기준

전일종가 +0.0 %

종목별 매수조건

종목당 매수비중

10 %

종목당 최대 매수금액

제한없음 만원

매수 종목수 조건

최대 보유종목 수

10 종목

1일 최대 매매종목 수

제한없음 종목

매도조건

퇴출(stop) 조건

목표가

매수가의 + 20 %

손절가

매수가의 - 15 %

보유일 관련 조건

종목 최소 보유일

0 일

종목 최대 보유일

5 일

만기매도 가격기준

전일종가 +0.0 %

매도조건 부합시 매도방법

조건 부합시 매도 가격기준

전일종가 +0.0 %

트레이딩시스템

☐ 사용함
 ☒ 사용안함

목표가 : 20% 손절가 : 15%

종목 최대 보유일 : 22일

1일 최대 매매종목 수 : 5종목

매수조건식 선택

A {주가수익률(PER)점수} >= 40

B {주가순자산률(PBR)점수} >= 40

C {자기자본이익률(ROE)점수} >= 40

D {가치점수} >= 40

E {성장점수} >= 40

F {주가수익률(PER)} >= 1

+ 조건식 추가하기

❗ PER, PBR, ROE, 가치, 성장점수와 PER팩터를 직접 넣어보
세요!

매수조건식 설정

A and B and C and D and E and F

조건식 검증하기

조건식 설정안내

매수종목선택 우선순위

{시가총액}

☐ 내림차순
 ☒ 오름차순

시가총액 오름차순 = 시가총액 낮은 순으로 매수

포트 제목
가치주 포트폴리오 2

포트 설명 (선택사항)
포트폴리오에 대한 설명을 100자 이내로 남겨주세요.

기본 조건

운용자금 5,000 만원	운용기간 2014/01/02 부터 2017/07/06 까지 상한기준 30% 변동일(2015/06/15) 기준 이전 이후	수수료율 0.100 %	슬리피지 0.000 %
-------------------------	---	------------------------	------------------------

매수조건

매수 가격기준
전일종가 +0.0 %

종목별 매수조건

종목당 매수비중 3 %	종목당 최대 매수금액 제한없음 만원
최대 보유종목 수 30 종목	1일 최대 매매종목 수 제한없음 종목

매도조건

퇴출(stop) 조건

목표가 매수가의 + 999 %	손절가 매수가의 - 999 %
---------------------	---------------------

보유일 관련 조건

종목 최소 보유일 0 일	종목 최대 보유일 20 일	만기매도 가격기준 시초가
------------------	-------------------	------------------

매도조건 부합시 매도방법

조건 부합시 매도 가격기준 전일종가 +0.0 %	트레이딩시스템 ☐ 사용하지 않 ☒ 사용안함
-------------------------------	---

목표가 / 손절가 : 999%(무제한)

종목 최대 보유일 : 20일
만기매도 가격기준 : 시초가

종목당 매수비중 : 3%
최대 보유종목 수 : 30종목

주가순자산률(PBR)점수

주가순자산률(PBR)

트레이딩 PBR

주가순자산률(PBR)점수

기업의 펀더멘탈 중 가치를 측정하는 팩터 중 하나인
주가순자산률(PBR)을 상대평가한 랭크점수
입력방법 : 0 ~ 100점(높을수록 좋음)

입력하기

PER점수 + PBR점수 > 150

{주가수익률(PER)점수}+{주가순자산률(PBR)점수}

>

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 prior 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.