

젠포트 사용자매뉴얼 v1.89





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 (일봉/틱 데이터 활용 가능)
- **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**

◎ 자주 묻는 질문

• 젠포트는 무료인가요?

대부분의 서비스는 무료이지만, 하루 2회 이상 백테스팅을 하거나 검증된 전략을 구매하는 등의 행위는 유료입니다.

• 전략을 직접 만들지 못하면 꼭 구매해야 하나요?

젠마켓(무료 알고리즘 마켓)에서 복사해서 사용하실 수 있습니다.

• 전략을 잘 만들고 싶은데 어떻게 해야 하나요?

뉴지스탁에서 제공하는 무료 강의를 듣거나, 젠포트 전문가들이 진행하는 전문가 강의를 통해 공부를 하실 수 있습니다.

또한, [젠포트 커뮤니티](#)(참여코드: newsy)에서 다른 유저와 전략 아이디어를 공유할 수 있으며, [전략문의](#) 게시판을 통해 원하는 전략을 구성하실 수 있습니다. 우선 매뉴얼 마지막 부근에 있는 '샘플 포트 만들기' 부터 따라 만들어 보시기 바랍니다.

• 모든 증권사를 통해 자동매매를 할 수 있나요?

2019년 12월 19일 기준 현재는 키움증권만 가능하며, 다른 증권사 전용으로도 개발 중입니다.

• 한국 주식만 커버하나요?

현재 한국과 미국 주식+ETF를 커버하고 있으며, 미국 젠포트는 [뉴지링크US](#) 에서 활용 가능합니다.

• 백테스팅(과거)과 실전매매(미래)가 동일할 수 있나요?

유동성(거래대금)이 풍부하고 보유주식을 많이 가져갈수록 실전과 유사한 결과가 나옵니다.

◎ 더알아가기

젠포트 공식 카페 : <https://cafe.naver.com/newsystock>

뉴지스탁 블로그 : <https://blog.naver.com/newsystock>

카카오톡 플러스친구 : https://pf.kakao.com/_kxgExjl

젠포트 전략 공유 오픈채팅방(참여코드: newsy) : <https://open.kakao.com/o/gClmcZu>

젠포트 WikiDocs : <https://wikidocs.net/book/1150>

젠포트 조건식 가이드 :

https://docs.google.com/spreadsheets/d/1NFa92_yLFpT0gcN4aWpAEDnnmaJFzneOVIZgn5AH94Y/edit?usp=sharing

젠포트 자주 묻는 질문: <http://genport.newsystock.com/Common/FAQ.aspx>

전략 문의: <http://genport.newsystock.com/Common/AskStrategy.aspx>

◎ 참고영상



- 젠트레이더(자동매매)는 개인 PC나 AWS 둘 중 하나에 설치하시면 됩니다.


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




인기많은 포트



수익률 급등 포트



투자기간별 포트



운용금액별 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 ▼

총 618 개의 포트가 검색되었습니다.

리스트 정렬 가상매매 수익률순 ▼


2265
westend_20160419_뉴지 리버스(순)
by westend 전체공개 7 copy

발류에이션




아주 높음

위험도




보통

가상매매 수익률



10.34%
2016/04/19 (15개월)

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 밅스 전체공개 1 copy

발류에이션




보통

위험도



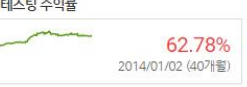
낮음

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)

V138829 가치_계절제거(10종목)_복사 4 평가지표확인

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

설명이 없습니다.

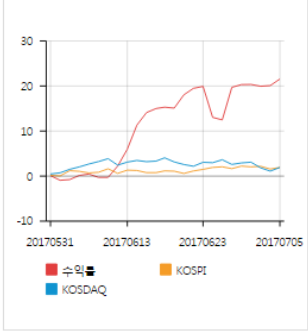
일평균 수익률	누적 수익률	연환산 수익률	투자원금	총 손익	남은 현금	현재 총 자산
0.81%	21.55%	294.77%	30,000,000원	5,972,599원	597,725원	36,464,630원

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

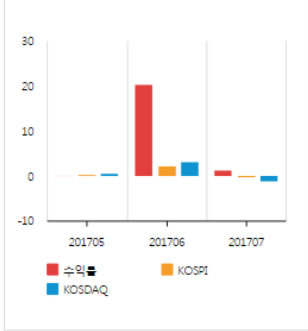
가상매매 수익률

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

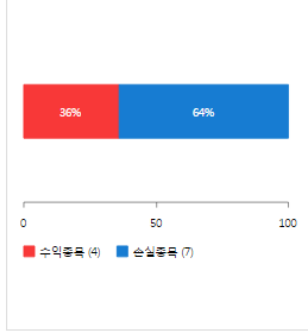
가상매매 누적수익률 차트



가상매매 월간수익률 차트



가상매매 승률



백테스팅 수익률

- 해당 포트의 상세한 수익률, 거래내역, 통계 등 확인 가능

백테스팅 포트 (90 / 100)

포트명	수익률
가치_계절제거(10종목)_복사	1298.22%
가치주포트	105.61%
전포트관리자_20170705_102151	162.41%
하위 파생 ETF	4.27%
종대형 투자 샘플	100.71%

가상매매 포트 (24 / 20) 휴지통

포트명	수익률
금융	14.08%
블류(구)	37.48%
중기하락 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 무물어깨	115.32%
경기민감(대형)	29.59%
동전주	128.71%

B145132 가치_계절제거(10종목)_복사 ✎

2014/01/02~2016/12/29 (36개월) 전체공개

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

0 포트비교 평가지표확인

새 포트

포트수정

포트복사

포트삭제

관리자복사

- 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

- 2007년 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

젠프로

새 포트 만들기

새 가상 포트 만들기

포트 관리하기

전략문의

새 포트 만들기

일봉 데이터를 활용한 백테스트입니다.
백테스팅 속도는 빠르지만 틱데이터 백테스트 대비 정확도가 낮다는 단점이 있습니다.
2007년 이후 백테스트가 가능합니다.

새 가상 포트 만들기

틱 데이터를 활용한 백테스트입니다.
정확도는 높지만 백테스팅 속도가 느리다는 단점이 있습니다.
2017년 이후 백테스트가 가능합니다.

새 포트 만들기 젠프가 제공하는 다양한 조건으로 나만의 투자전략을 만들어 보세요.

젠프로 > 새 포트 만들기

일반 (1) NH (2)

2

Step 1. 기본 설정

기본 조건들을 설정하세요.

3

Step 2. 매매대상 설정

매매할 대상들을 설정하세요.

4

Step 3. 매매조건 설정

매수/매도조건을 설정하세요.

5

Step 4. 포트 최적화

최적의 조건을 찾아보세요.

Step 5. 포트 완성!

백테스팅 포트가 완성되었습니다.

- 1 증권사 선택 : NH투자증권 자동매매를 하기 위해서는 'NH' 전용 포트를 만들어야 합니다.
- 2 기본 설정: 어느 기간동안 얼마로 몇 종목을 최대 며칠 동안 보유할지 등의 기본 조건을 설정하는 화면입니다.
- 3 매매대상 설정: 대형주, 소형주, ETF, 테마주, 관심종목 등 투자할 유니버스를 선택하는 화면입니다.
- 4 매매조건 설정: 매수와 매도에 대한 상세 조건을 설정하는 화면입니다.
- 5 포트 최적화: 여러 조건을 비교해 최적 값을 찾아내는 화면입니다.

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		매도조건	
매수 가격기준 전일증가 +0.0 %		퇴출(stop) 조건 목표가: 매수가의 + 10.0 % 손절가: 매수가의 - 10.0 %	
종목별 매수조건 종목당 매수비중 10 % 종목당 최대 매수금액 제한없음 만원 종목당 전체 자산 대비 10% 비중으로 매수		보유일 관련 조건 종목 최소 보유일 0 일 종목 최대 보유일 5 일 만기매도 가격기준 전일증가 +0.0 %	
매수 종목수 조건 최대 보유종목 수 10 종목 1일 최대 매매종목 수 제한없음 종목 최대 10종목 매수		매도조건 부합시 매도방법 조건 부합시 매도 가격기준 전일증가 +0.0 % 트레이일링스탑 사용 안함	
필터링 조건 관리종목 제외 포함 감리종목 제외 포함		※ 매도조건 우선순위 종목 최소 보유일 매도 > 매도조건 부합시 매도 > 종목 최대 보유일 매도 > 손절가 매도 > 목표가 매도	
※ 매수조건 우선순위 종목당 매수비중 > 최대 보유종목 개수 > 종목당 최대 매수금액 > 1일 최대 매수종목 수			

- 기본적인 매매 기준 설정 화면 (초보자일 경우 부분만 변경)

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

<input checked="" type="radio"/> 유니버스/업종 ?	<input type="radio"/> 테마 ?	<input type="radio"/> 관심종목 ?
--------------------------------------------	----------------------------	------------------------------

유니버스 선택

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

업종 선택

에너지	<input checked="" type="checkbox"/> 석유와 가스
소재	<input checked="" type="checkbox"/> 철강 <input checked="" type="checkbox"/> 종이 / 목재 <input checked="" type="checkbox"/> 사료 <input checked="" type="checkbox"/> 비철금속 <input checked="" type="checkbox"/> 화학
	<input checked="" type="checkbox"/> 농업 / 비료 <input checked="" type="checkbox"/> 강관업체 <input checked="" type="checkbox"/> 건축자재 <input checked="" type="checkbox"/> 포장재
산업재	<input checked="" type="checkbox"/> 조선 / 해운 <input checked="" type="checkbox"/> 운수창고 / 운송 <input checked="" type="checkbox"/> 건설 <input checked="" type="checkbox"/> 항공 <input checked="" type="checkbox"/> 환경
	<input checked="" type="checkbox"/> 철도 <input checked="" type="checkbox"/> 공작기계 <input checked="" type="checkbox"/> 재난 / 안전 <input checked="" type="checkbox"/> 유통 <input checked="" type="checkbox"/> 전기장비
	<input checked="" type="checkbox"/> 방산 / 우주항공

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

매수조건식 선택

+ 조건식 추가하기

매수조건식 설정

예) A and B and C and D and E

매수종목선택 우선순위 (종합점수)

매도조건식 선택

+ 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

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

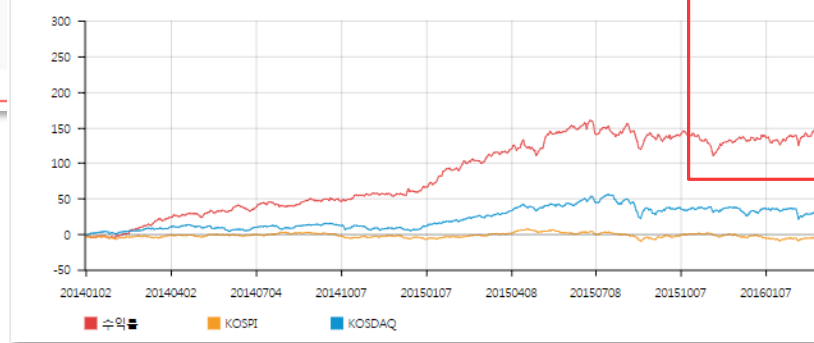
- 조건 값들을 수정 후, 최적화 기능을 통해 **최적의 조건 값을 확인** 가능
- 최적화된 조건 값을 선택하여 **최종 백테스팅 포트**를 생성

백테스팅 포트 ? (91 / 100)

포트명	수익률
수급 강세 종목 투자	261.11%
가치_계절제거(10종목)_복사	1298.22%

가치주포트	포트정보	설정조건	매매결과	수익률	매매종목 정보	거래내역
전포트관리자_20170705_102 누적 수익률						

하의 파생 ETF



추천 종목 ● 매수 대상종목 ● 이미 보유한 종목

엘앤케이바이오	A156100 Q
하나머티리얼즈	A166090 Q
풍산홀딩스	A005810 Q
다나와	A119860 Q
와이엠씨	A155650 Q

- 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 무를어깨	115.32%
경기민감(대형)	29.59%
등전주	128.71%

1 백테스팅 포트

과거 일정 기간동안 매매한 결과를 볼 수 있는 포트
직접 만들거나 젤마켓에서 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

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

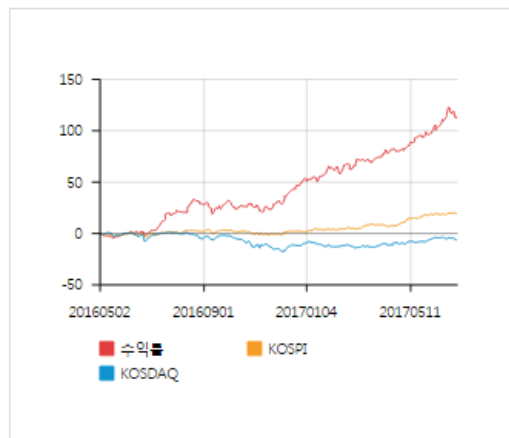
활용 : 검증을 마친 전략을 **증권계좌와 연동하여 젤트레이더로 자동매매** 실행

- 1 포트정보
- 2 설정조건
- 3 매매결과
- 4 수익률
- 5 매매종목 정보
- 6 거래내역

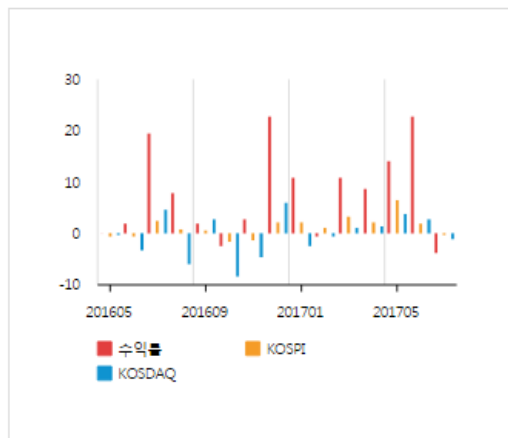
실전매매 수익률

최근 거래일	최근 일주일	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
1.69%	-3.27%	9.15%	22.6%	43.13%	109.05%

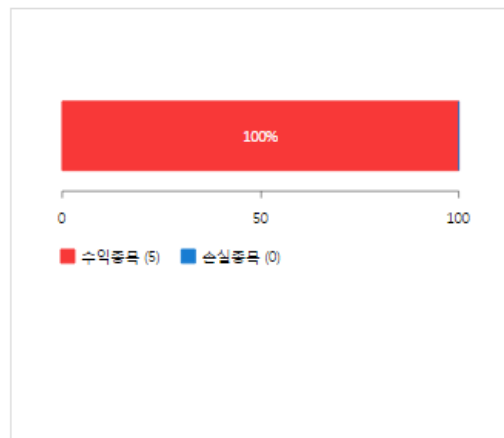
실전매매 누적수익률 차트



실전매매 월간수익률 차트



실전매매 승률



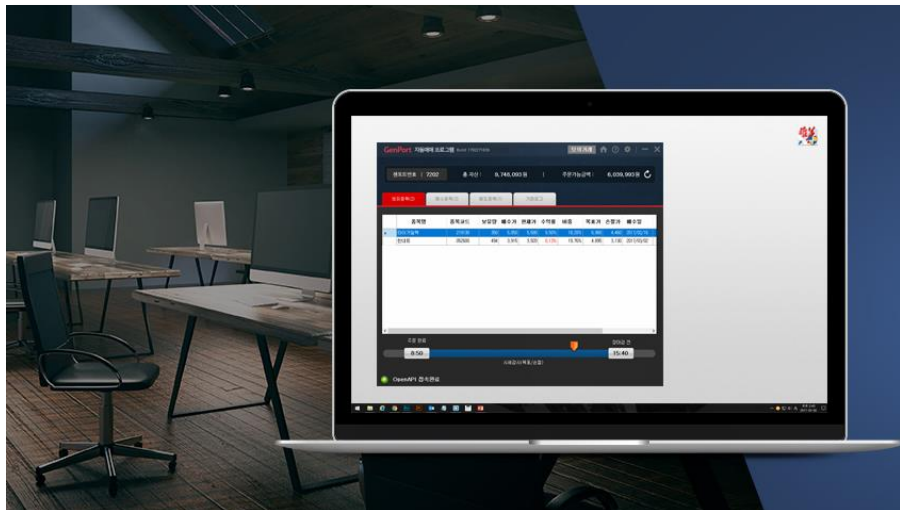
- 1 포트정보 백테스팅/가상매매/실전매매 포트에 대한 수익률 및 승률 정보
- 2 설정조건 매수/매도 조건
- 3 매매결과 통계
- 4 수익률 기간 누적 수익률, 차트, 매도종목 수익률 확인 가능
- 5 매매종목 정보 추천종목 (매수조건에 성립하는 종목 매일 최대 20개 제공)
보유종목 (현재 보유 중인 종목)
매수종목 (실제 매수할 종목)
매도종목 (실제 매도할 종목)
- 6 거래내역 운용기간 동안 매매를 했던 거래내역 확인 가능



젠트레이더

뉴지스탁에서 자체 개발한 포트폴리오 자동매매 프로그램

- 젠포트 실전매매 포트와 연동되어 실제 계좌를 자동으로 관리



젠트레이더

감성적 투자의 시대는 끝났다!
기존에 없던 자동매매의 새로운 패러다임

프로그램 다운로드

매뉴얼 다운로드

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



TV캐스트

뉴지스탁에서 제공하는 모든 방송 시청 가능

제육볶서님 환영합니다. | My뉴지 | 로그아웃 | 관리자 메뉴 | 고객센터 | Family Site

NEWSY STOCK GENPORT

젠포트란? 젠프로 젠트레이더 **TV캐스트**

TV캐스트

TV캐스트

메인 >

전문가 채널

지인킵

뉴지 채널

방송 스케줄

회원후기

젠포트 고객센터
1899-0955
 평일 09:00 ~ 18:00
 (주말, 공휴일 휴무)

@뉴지스탁

나에게 **딱맞는 전략**을 만들어보세요!
 지인킵의 Value-Based 포트 실제 수익률
 ▲ 4,868.77%
지인킵의 알쏭신전 수강하기

세계 1위의 레노버,
로보어드바이저를
 만나다!
 Lenovo MIX 320 +
 프리미엄 내방 서비스

전체 젠마켓 TOP5 **1** 모닝브리프 **2** 교육방송 **3** 이용가이드

4 뉴지스탁 전문가

젠포트의 기본부터 시작하라
문홍집 대표

당신도 전문가에 도전하세요
Who's Next

전문가 유료강의
 진행중인 패키지 종료된 패키지

젠포트 기본개념 총정리
 강사 문호준 | 2017/07/05

[젠포트 활용법] 젠트레이더
 강사 문호준 | 2017/05/15

[젠포트 활용법] 포트 관리하기
 강사 문호준 | 2017/05/15

[젠포트 활용법] 포트 복사하기, 젠마켓
 강사 문호준 | 2017/05/15

[젠포트 활용법] 새 포트 만들기
 강사 문호준 | 2017/05/15

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!

◎ 전략 검증부터 운용까지 기본적으로 백테스팅과 가상매매로 전략을 검증, 실전매매로 운용합니다

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) 휴지통

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

실전매매 포트 (12)

포트명	수익률
엔벨 중심선 활용	39.6%
신고가 증목 공략	25.08%
대형주 무릎어깨	115.22%
경기민감(대형)	
등전주	

젠프로

- 1 새 포트 만들기
- 4 새 가상 포트 만들기
- 포트 관리하기
- 전략문의

1 **젠프로-새 포트 만들기** 를 통해 백테스팅(일봉)을 하실 수 있습니다.

2 **백테스팅** 2007년 이후부터 '일봉' 기준 시뮬레이션을 통해 전략을 검증할 수 있습니다

3 **가상매매** 백테스팅에서 만든 전략을 가상매매로 옮기면 그 다음 영업일부터 모의투자가 진행되어 한번 더 검증할 수 있습니다

4 **틱테스팅** '젠프로-새 가상 포트 만들기'를 통해 틱데이터를 활용한 백테스팅을 진행할 수 있습니다. (2017년 이후 데이터)

5 **실전매매** 젠트레이더(자동매매)와 연동하여 자동으로 자산을 관리할 수 있습니다.

◎ 포트만들기(백테스팅 하기)

새 포트 만들기 전포트가 제공하는 다양한 조건으로 나만의 투자전략을 만들어 보세요.

전포트 > 새 포트 만들기

Step 1. 기본 설정

기본 조건들을 설정하세요.

Step 2. 매매대상 설정

매매할 대상들을 설정하세요.

Step 3. 매매조건 설정

매수/매도조건을 설정하세요.

Step 4. 포트 최적화

최적의 조건을 찾아보세요.

Step 5. 포트 완성!

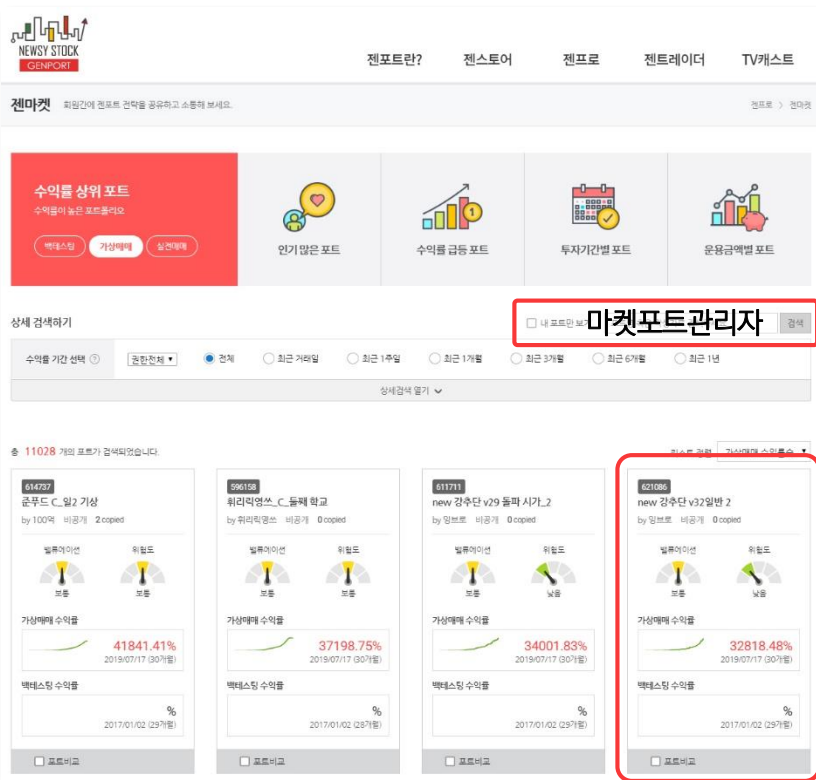
백테스팅 포트가 완성되었습니다.

- ① STEP 1 매수 비중, 목표/손절가, 보유기간 등 기본적인 설정을 할 수 있습니다.
- ② STEP 2 개별종목 및 ETF, 테마 및 관심종목 등 원하는 투자 대상을 설정할 수 있습니다.
- ③ STEP 3 보다 상세한 매수/매도 조건식 및 우선순위를 설정할 수 있습니다.
- ④ STEP 4 한번에 다양한 전략들을 백테스팅하여 최적화를 할 수 있습니다.

◎ 아래 샘플들을 직접 만들어보세요.

- ① 수급 외국인과 기관의 수급이 좋은 종목을 활용
- ② 가치 펀더멘탈이 좋은 종목을 활용
- ③ 퀀트 일반적인 퀀트 이론을 활용
- ④ 초단기 역추세 당일 역추세 매매를 통해 높은 수익률을 추구
- ⑤ ETF 레버리지/인버스 ETF만을 활용
- ⑥ 마켓타이밍 시장이 어려울 땐 매수를 하지 않는 전략

◎ 젠마켓(무료 알고리즘 마켓)에서 다양한 샘플 포트를 만나 보실 수 있습니다.



The screenshot shows the GenMarket website interface. At the top, there are navigation tabs: '젠포트란?', '젠스토어', '젠프로', '젠트레이더', and 'TV캐스트'. Below this is a search bar with the text '내 포트만 보' and a search button labeled '마켓포트관리자'. The main content area displays a grid of portfolio cards. Each card includes a title, a brief description, a risk level indicator (represented by a gauge), and a performance chart showing '가상매매 수익률' (Virtual Trade Return) and '백테스팅 수익률' (Backtesting Return). The fourth card in the grid is highlighted with a red box, corresponding to the '마켓포트관리자' search results.




The screenshot shows the '백테스팅 포트' (Backtesting Portfolio) page, displaying a list of portfolios with their respective returns. The page title is '백테스팅 포트 (91 / 100)'. The table below shows the following data:

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%

Below the table, there is a search bar with the text '가상매매' and '수급 데이터 트레이딩_v3'. A red arrow points from the '복사' button in the search bar to the '복사' button in the search bar of the '백테스팅 포트' page.

젠스토어 - 젠마켓 - 가상매매 - '마켓포트관리자' 검색

마음에 드는 포트를 선택한 후  포트복사 클릭

복사한 포트는 젠프로 - 포트 관리하기 - 백테스팅 포트에서 확인 가능

◎ 아래 전략을 보고 직접 알고리즘을 백테스팅 해보세요.

매수조건

일반매수 | 분할매수 | 풀파매수

매수 가격기준

전일종가 +0.0 %

종목별 매수조건

종목당 매수비중 10 % | 종목당 최대 매수금액 제한없음 만원

매수 종목수 조건

최대 보유종목수 10 종목 | 1일 최대 매매종목수 제한없음 종목

매도조건

퇴출(stop) 조건

목표가 | 손절가

매수가의 + 10.0 % | 매수가의 - 10.0 %

보유일 관련 조건

종목 최소 보유일 0 일 | **종목 최대 보유일 5 일** | 만기매도 가격기준 전일종가 +0.0 %

매도조건 부합 시 매도방법

조건 부합 시 매도 가격기준 전일종가 +0.0 % | 트레이딩스탑 사용함

종목 최대 보유일 : 2일

❗ STEP 1

우선순위 '윗꼬리비율' 내림차순 선택

매수종목선택 우선순위 (윗꼬리비율) | 내림차순 | 오름차순

❗ STEP 4 매도로직에 (수급점수 < 10) 을 넣어주면 수익률이 더 좋아집니다!

백테스팅 실행하기

❗ STEP 3

매수조건식 선택

+ 조건식 추가하기

조건을 단어로 검색해 보세요. | 조건선택 가이드

- 종합
- 종합점수
- 업종종합점수
- 모멘텀
- 가격
- 수급 수급 검색 ▶ 수급점수 선택
 - 수급점수
 - 수급점수 과거값
 - 수급점수 평균
 - 수급점수 변화량

수급점수

시장의 수급 모멘텀을 측정하는 척도인 거래량, 수급 등을 상대평가한 점수

입력방법: 0 ~ 100점(높을수록 좋음)

입력하기

(수급점수) >

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 <input type="checkbox"/> 이전 <input type="checkbox"/> 이후	수수료율 0.100 %	슬리피지 0.000 %
-------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------	------------------------

매수조건

매수 가격기준
전일종가 +0.0 %

종목별 매수조건
종목당 매수비중 10 %
종목당 최대 매수금액 만원
 제한없음

매수 종목수 조건
최대 보유종목 수 10 종목
1일 최대 매매종목 수 5 종목
 제한없음

매도조건

퇴출(stop) 조건
목표가 : 20 % 손절가 : 15 %
매수가의 + 20 % 매수가의 - 15 %

보유일 관련 조건
종목 최소 보유일 0 일
종목 최대 보유일 5 일
만기매도 가격기준 전일종가 +0.0 %

매도조건 부합시 매도방법
조건 투할시 매도 가격기준 전일종가 +0.0 %
 사용하지 않음 사용안함

목표가 : 20% 손절가 : 15%

종목 최대 보유일 : 22일

1일 최대 매매종목 수 : 5종목

STEP 1

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

STEP 3

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

매수조건식 설정

A and B and C and D and E and F

매수종목선택 우선순위 내림차순 오름차순

시가총액 오름차순 = 시가총액 낮은 순으로 매수

매수조건

일반매수 | 분할매수 | 톱픽매수

매수 가격기준 ?
전일종가 +0.0 %

종목별 매수조건

종목당 매수비중 ? : 5 %
종목당 최대 매수금액 ? : 제한없음 만원

매수 종목수 조건

최대 보유종목 수 ? : 30 종목
1일 최대 매매종목 수 ? : 0 종목

필터링 조건 ?

매도조건

퇴출(stop) 조건 ?

목표가 : 매수가의 + 0 %
손절가 : 매수가의 - 0 %

보유일 관련 조건

종목 최소 보유일 ? : 0 일
종목 최대 보유일 ? : 20 일
만기매도 가격기준 ? : 증가

매도조건 부합 시 매도방법

조건 부합 시 매도 가격기준 ? : 증가
트레이딩리스트 ? : 사용함 사용안함

목표가 / 손절가 : 0%(무제한)

종목 최대 보유일 : 20일
만기매도 가격기준 : 증가

조건 부합 시 매도 가격기준 : 증가

종목당 매수비중 : 3%
최대 보유종목 수 : 30종목
*정상적으로 모든 종목이 매수된다면
30종목까지 매수될 일은 없습니다.

STEP 1



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

STEP 3

- ❗ 초단기 역추세 매매는 **틱데이터 백테스팅**으로 해보세요!
젠프로 - '새 가상 포트 만들기' 를 통해 진행 가능합니다.

매수조건

일반매수 | 분할매수 | **돌파매수** 돌파매수 전일증가 -5%

돌파 매수

돌파 전일증가 0.0 %

종목별 매수조건

종목당 매수비중 30 % 종목당 최대 매수금액 제한없음 만원

매수비중 30% **매수 종목수 조건**

최대 보유종목 수 10 종목 1일 최대 매매종목 수 제한없음 종목

필터링 조건

관리종목 감리종목

제외 포함 제외 포함

매도조건

퇴출(stop) 조건

목표가 손절가

매수가의 + 7 % 매수가의 - 10 %

보유일 관련 조건

종목 최소 보유일 0 일 종목 최대 보유일 0 일 만기매도 가격기준 전일증가 +0.0 %

매도조건 부합 시 매도방법

조건 부합 시 매도 가격기준 전일증가 +0.0 % 사용함 사용안함

매도 옵션

증가 청산 사용안함 시장가 지정가

목표가 : 7% / 손절가 : -10%
 종목 최소 / 최대 보유일 0일(당일매매)
 증가 청산 사용

❗ STEP 1

매수조건식 선택

A [(수급점수) > 50] + 조건식 추가하기

매수조건식 설정

A [(수급점수) > 50] 조건식 검증하기 조건식 설정안내

매수종목선택 우선순위

[일별주가상승률] 내림차순 오름차순 **일별주가상승률 '오름차순'**

❗ STEP 3

- ❗ STEP2 에서 원하는 매매대상을 설정할 수 있습니다.
ETF만을 선택해보세요!

매수조건

일반매수 | 분할매수 | 돌파매수

매수 가격기준 ?

당일시초가 ▼ **당일시초가**

종목별 매수조건

종목당 매수비중 ? **50%** | 종목당 최대 매수금액 ? **제한없음 만원**

매수 종목수 조건

최대 보유종목 수 ? **10** 종목 | 1일 최대 매매종목 수 ? **제한없음** 종목

매도조건

퇴출(stop) 조건 ?

목표가 | 손절가

매수가의 + **0** % | 매수가의 - **10** %

목표가 0% | 보유일 관련 조건 | 손절가 -10%

종목 최소 보유일 ? **0** 일 | 종목 최대 보유일 ? **999** 일 | 만기매도 가격기준 ? **시초가**

999일 매도조건 부합 시 매도방법 | **시초가**

조건 부합 시 매도 가격기준 ? | 트레이딩링스탑 ?

사용함 | 사용안함

❗ STEP 1

유니버스/업종 ?

유니버스 선택 | 관제선택 | 선택해제

코스피 중대형 | 코스피 중소형 | 코스닥 대형 | 코스닥 중형 | 코스닥 소형 | 코스닥 초소형 | ETF

❗ STEP 2

ETF만 선택

팩터 설명

매수

- A: 전일 증가가 20일 이동평균선보다 10% 미만
 B: 전일 증가가 20일 이동평균선보다 0% 이상
 C: 전일 증가가 20일 이동평균선보다 -1% 미만
 *any(C,5): 5일 이내 C가 1번 이상 성립
 D: 5일 이동평균선 > 20일 이동평균선
 E: 5일 평균 거래대금 50억원 이상

매도

- A: 전일 증가가 20일 이동평균선보다 -5% 미만
 *every(A,4): A가 4일 연속 지속

매수조건식 선택 ?

A 이격도(20일) < 110 | B 이격도(20일) > 100 | C 이격도(20일) < 99

D 이동평균(종가,5일)-이동평균(종가,20일) > 0 | E 이동평균(거래대금,5일) > 5000000000

매수조건식 설정

A and B and any(C,50) and D and E

(이격도(20일) < 110 and (이격도(20일) > 100) and (이격도(20일) < 99) and (이동평균(종가,5일)-이동평균(종가,20일) > 0) and (이동평균(거래대금,5일) > 5000000000))

매수종목선택 우선순위 ? (조합경우) | 내릴차순 | 오를차순

매도조건식 선택 ?

A 이격도(20일) < 95

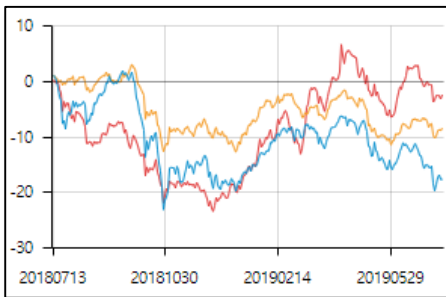
매도조건식 설정

Every(A,4)

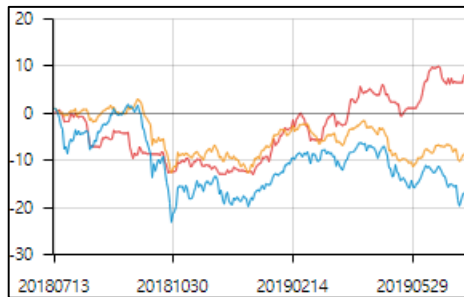
(이격도(20일) < 95)

❗ STEP 3

❗ 지수 팩터를 이용해 마켓타이밍을 만들어 보세요



원본



마켓타이밍 적용

❗ 종합점수 > 70 만을 사용한 알고리즘에 마켓타이밍을 넣었더니 수익률과 MDD가 개선!

- KOSPI지수_증가
- KOSPI지수_증가 과거값
- KOSPI지수_증가 평균**
- KOSPI지수_증가 변화량
- KOSPI지수_증가 변화율
- KOSDAQ지수_시가
- KOSDAQ지수_고가
- KOSDAQ지수_저가
- KOSDAQ지수_종가
- KOSDAQ지수_종가 과거값
- KOSDAQ지수_종가 평균
- KOSDAQ지수_종가 변화량

KOSPI지수_증가 평균

KOSPI지수_증가

5일

10일

20일

60일

3 일

입력하기

{KOSPI지수_증가}-이동평균({KOSPI지수_증가},{3일})



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.