
가상자산 샘플 포트 만들기

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

◎ 한국주식, 미국주식, 가상자산 백테스트 가능

전프로

새 포트 만들기
포트 관리하기
전략문의
수익률 후기



트레이딩 포트

다양한 팩터를 활용한 나만의 전략
알고리즘 트레이딩 포트 만들기

월봉
무료

일봉
최근 1년 무료

틱
일 1회 무료

백테스트 속도 느림
백테스트 정확도 낮음

뉴지형크US로 연결됩니다



미국주식 포트

이제는 미국주식에 투자할 때
미국주식 포트 만들기

월봉
무료

일봉
무료

자산배분
무료

백테스트 속도 빠름
백테스트 정확도 높음



자산배분 포트

여러 자산군에 대한 분산투자
자산배분 포트 만들기

일봉
최근 1년 무료

틱
일 1회 무료

지수
일 1회 무료

백테스트 속도 보통
백테스트 정확도 보통



가상자산 포트

24시간 가상자산 시장도
내 손안에서 편하게!

가상자산 포트만들기 무료
15분봉 / 30분봉 / 1시간봉 / 1일봉 단위로 설정 가능

매매방식

- 트레이딩** 전략에 따라 종목을 선정하며, 단타부터 중장기 매매까지 다양한 전략 구성
- 자산배분** 정해진 종목을 1개월, 1분기, 1년 등 특정 기간 마다 리밸런싱하는 전략 구성

데이터

- 월봉** 월봉 데이터를 활용하여 2007년 이후 백테스팅 가능 (무료) - 자산배분 방식 리밸런싱
- 일봉** 일봉 데이터를 활용하여 2007년 이후 백테스팅 가능 (일 1회 무료)
- 틱** 틱 데이터를 활용하여 2017년 이후 백테스팅 가능 (일 1회 무료)
- 지수** 지수 데이터를 활용하여 1980년 이후 백테스팅 가능 (일봉 이용권 차감)

◎ 리밸런싱이란

보유 종목을 매도하고 새로운 종목을 매수하는 것을 **리밸런싱**이라고 합니다.

◎ 일봉/틱 트레이딩

보유 종목을 모두 매도하고 새로 매수합니다.

PBR 하위 10개 종목으로 1개월(or 20영업일)에 한 번씩 리밸런싱을 할 경우 같은 종목을 다 팔고 새로 매수할 수도 있습니다.

***가상자산은 틱데이터를 사용합니다.**

◎ 월봉 트레이딩, 일봉/틱/지수 자산배분

보유 종목과 새로 매수할 종목이 같을 경우 넘치는 부분을 팔고, 부족한 부분을 매수합니다.

자산배분에 대해 궁금하신 점은 [제나짱이 되는 길](#) 콘텐츠를 참고해주시기 바랍니다.

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

백테스팅 포트 (91 / 100)		가상매매 포트 (24 / 20)		휴지통	실전매매 포트 (12)			
포트명	수익률	포트명	수익률		포트명	수익률		
1	수급 강세 증목 투자	261.11%	2	금융	14.08%	3	엔벨 중심선 활용	39.6%
	가치_계절제거(10종목)_복사	1298.22%		발류(구)	37.48%		신고가 증목 공략	25.08%
	가치주포트	105.61%	>	중기하락 성장주	33.01%		대형주 무릎어깨	115.32%
	젠포트관리자_20170705_102151	162.41%		외인수급	32.05%		경기민감(대형)	29.59%
	해외 파생 ETF	4.27%		주도업종	21.69%		등전주	128.71%

- 1 백테스팅 2007년 이후부터 '일봉' 기준 시뮬레이션을 통해 전략을 검증할 수 있습니다.
- 2 가상매매 백테스팅에서 만든 전략을 가상매매로 옮기면 그 다음 영업일부터 모의투자가 진행되어 한번 더 검증할 수 있습니다.
- 3 실전매매 젠트레이더(자동매매)와 연동하여 예약주문을 할 수 있습니다.

◎ 포트만들기(백테스팅 하기)

새 포트 만들기

젠프트가 제공하는 다양한 조건으로 나만의 투자전략을 만들어 보세요.

젠프로 > 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. (현재 미지원)

◎ 아래 샘플들을 직접 만들어보세요.

- ① 거래량 증가 전 봉 대비 거래량이 급증한 코인 공략
- ② 마켓타이밍 시장이 어려울 땐 매수를 하지 않는 전략
- ③ 관심 코인 관심 코인만 활용하여 매매

수수료율 ?	슬리피지 ?	배치 지연 적용 ?
0.200 %	0.000 %	설정없음 ▾ 분

매수조건		매도조건	
매수 가격기준 ?		매도 가격기준 ?	
전봉증가 ▾ 0.0 %		전봉증가 ▾ 0.0 %	
종목별 매수조건		종목별 매도조건	
종목당 매수비중 ?	종목당 최대 매수금액 ?	종목당 매도비중 ?	종목당 최대 매도금액 ?
10 %	0 만원	10 %	0 만원
매수 종목수 조건		매도 종목수 조건	
최대 보유종목 수 ?	봉 단위 최대 매수 종목 수 ?	최대 보유종목 수 ?	봉 단위 최대 매도 종목 수 ?
10 종목	10 종목	10 종목	10 종목
저유동성 종목 필터링 ?			
<input checked="" type="radio"/> 적용 <input type="radio"/> 미적용 ※ 미적용 시 실전매매 포트로 연동이 되지 않습니다.			
보유종 관련 조건		배치 지연 적용 ?	
종목 최소 보유봉 ?	종목 최대 보유봉 ?	설정없음 ▾ 분	
0 봉	5 봉		
보유종 만기 매도 가격기준 ?			
전봉증가 ▾ 0.0 %			
조건 부합 시 매도 가격기준 ?			
전봉증가 ▾ 0.0 %			

배치 지연 (배치 타임컷)

가상자산은 24시간 돌아가기 때문에 데이터 기준(15분봉/30분봉/60분봉/1일봉)이 끝나면 매매 처리 및 신규 매매 종목을 선정할 시간이 필요합니다.

이를 '배치' 라고 표현하며, 실전에서는 배치가 최소 30초 정도 걸릴 수 있습니다. 실전과 괴리를 줄이는 방법으로 백테스트에서도 배치 시간을 추가할 수 있습니다.

*자세히 보기:

<https://cafe.naver.com/newsystock/4626>

저유동성 종목 필터링

가상자산 시장은 아직 주식 시장 대비 유동성(거래량)이 부족한 경우가 많습니다. 필터링을 적용할 경우 거래량이 부족한 가상자산은 자동으로 제외됩니다.

*자세히 보기: <https://cafe.naver.com/newsystock/6287>

목표/손절가

2022.08 기준 목표/손절가 기능이 지원되지 않기에 STEP3에서 매도조건식으로 목표/손절가를 잡아주셔야 합니다.

*자세히 보기: <https://wikidocs.net/168489>

◎ 아래 전략을 보고 직접 알고리즘을 백테스팅 해보세요.

STEP 1

매수조건

매수 가격기준 ?
전봉증가 0.0 %

종목별 매수조건

종목당 매수비중 ? 10 %
종목당 최대 매수금액 ? 0 만원

매수 종목수 조건

최대 보유종목 수 ? 10 종목
봉 단위 최대 매수 종목 수 ? 10 종목

매도조건

퇴출(stop)조건은 추후 업데이트 될 예정입니다
매도 조건식으로 목표 / 손절가 설정하는 법

보유종 관련 조건 96봉(15분봉 기준으로 1일)

종목 최소 보유봉 ? 0 봉
종목 최대 보유봉 ? 96 봉

보유종 만기 매도 가격기준 ? 96봉이 지나면 '전봉증가 -2%' 가격에 매도

전봉증가 -2.0 %

조건 부합 시 매도 가격기준 ? 매도 로직을 충족하면 '전봉증가 -2%' 가격에 매도

전봉증가 -2.0 %

STEP 3

매수조건식 선택 ?
A (증가) > 0

의미 없는 값 (우선순위로만 매수하기 위함)

매수조건식 설정
A

매수종목선택 우선순위 ?
변화를_기간((거래량).(1봉))

매도조건식 선택 ?
A (보유종목수익률) > 5
B (보유종목수익률) < -5

매도조건식 설정
A or B

5% 오르거나(or) -5% 하락 시 매도

거래량

거래량
BTC_거래량
ETH_거래량

거래량
거래량 일정 기간동안의 거래 수량의 합산.
데이터 범위 : 0.0 ~

합수 기본
인자 인자

변화를_기간((거래량).(1봉))

변화를_기간((거래량).(1봉))

거래량 → 기본:변화율

◎ 어려운 시장에서는 현금만 보유하거나 신규 매수를 하지 않는 로직

매수조건식 선택 ?

 {BTC_종가}-이동평균({BTC_종가},{3봉}) > 0 ×

 {BTC_종가}-이동평균({BTC_종가},{5봉}) > 0 ×

 {BTC_종가}-이동평균({BTC_종가},{10봉}) > 0 ×

매수조건식 설정



어제 증가가 BTC 3일, 5일, 10일 이동평균선보다 위에 있을 때 매수하는 전략

 A and B

A 변화율_기간({ETH_종가},{96봉}) > 0

B 변화율_기간({BTC_종가},{96봉}) > 0

 A or B

A 변화율_기간({ETH_종가},{96봉}) > 0

B 변화율_기간({BTC_종가},{96봉}) > 0

 A and B and C and D

A 변화율_기간({BTC_종가},{96봉}) < 0

B 변화율_기간({ETH_종가},{96봉}) < 0

C {보유종목보유봉} > 96

D {보유종목수익률}*{보유종목수익률} > 1

BTC, ETH를 활용한 마켓타이밍 매수/매도 전략

 *출처: 사람아름님 게시글: <https://cafe.naver.com/newsystock/6266>

◎ '관심종목'만 매매 가능

Step 1. 기본 설정

기본 조건들을 설정하세요.

Step 2. 매매대상 설정

매매할 대상들을 설정하세요.

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

테마 ?

관심종목 ?

매매제외종목 ?

관심종목에서 선택

관심종목 관리

비트이더 (2)

비트코인 이더리움

관심종목관리

등록할 종목 선택

종목검색

- 전체종목
- 관심종목
- 테마

비트코인 검색

BCH	비트코인 캐시	+
BSV	비트코인사토시비전	+
BTC	비트코인	+
BTG	비트코인 골드	+

전체추가 ▶

등록된 그룹 새그룹

그룹명	종목수		
비트이더	2	복사	X

등록된 그룹 내 종목 ▼

코드	종목명	
BTC	비트코인	X
ETH	이더리움	X

종목별 매수조건

STEP 1

종목당 매수비중 ?

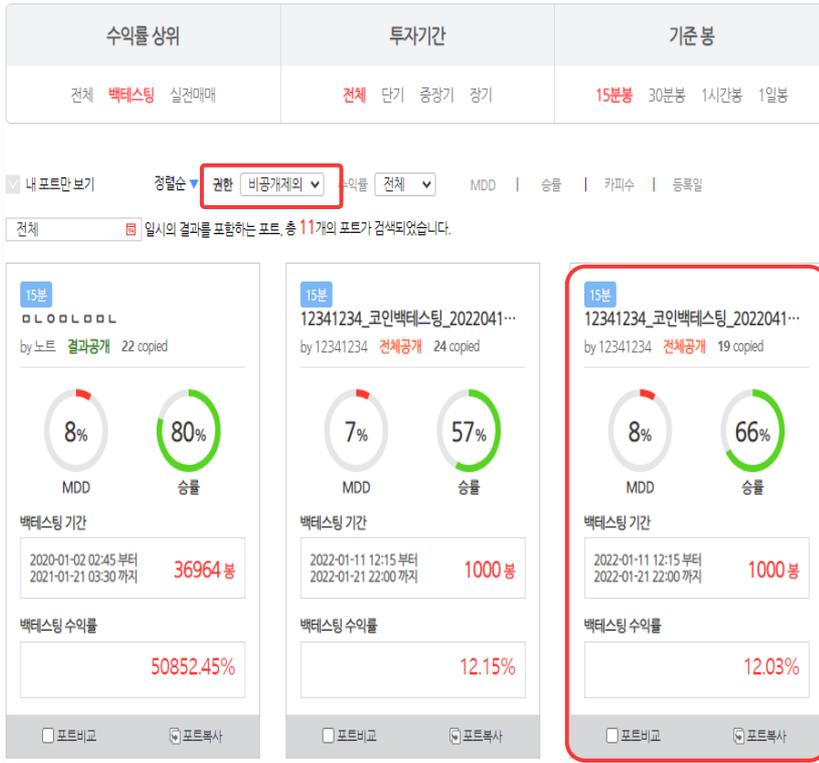
100 %

종목당 최대 매수금액 ?

제한없음 만원

종목 수를 적게 가져갈 경우 종목당 매수비중을 높여 주시는 것이 좋습니다.

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



젠스토어 - 젠마켓 - 포트권한(비공개제한)

마음에 드는 포트를 선택한 후  포트복사 클릭

복사한 포트는 젠프로 - 포트 관리하기 - 백테스팅 포트에서 확인 가능