

AI 기반 시스템 트레이딩 부트캠프 · 무료 자가진단

백테스트 거짓말 자가진단

6문항으로 - 당신의 백테스트가 진짜인지 30초 만에 가려낸다.

"AI가 짜준 화려한 곡선, 실제좌에선 왜 녹을까?"

수익을 보장하지 않습니다. 백테스트의 함정을 구분하고
내 전략의 기댓값·리스크·운영 가능성을 판단하는 능력을 위한 자료입니다.

이 6문항에 솔직히 답해보세요

AI에게 '자동매매 짜줘' 한 번이라도 해봤다면 - 화면에 뜬 연 120%·MDD 20% 곡선에 설렘을 겁니다. 그런데 실제좌에 넣으면 왜 녹을까요? 백테스트는 거짓말을 잘 합니다. 아래 6개를 '아니오'로 답할수록, 당신의 곡선엔 거짓말이 숨어 있습니다.

1 미래를 훑쳐보지 않았는가? (룩어헤드)

왜: 그날 종가·지표를 그날 진입에 쓰면 미래를 본 것. 지표에 shift(1)를 적용했는가.

☐ 예 ☐ 아니오

2 체결을 '다음 봉'으로 가정했는가?

왜: 신호 봉 종가에 바로 체결(X)은 현실 불가. 신호 확인 후 '다음 봉 시가/스톱'(O)이어야 한다.

☐ 예 ☐ 아니오

3 비용을 뺐는가? (수수료·슬리피지·펀딩비)

왜: 시물은 깨끗하지만 거래소는 수수료를 떼고 주문은 밀려 체결된다. 비용은 항상 수익을 깎는다.

☐ 예 ☐ 아니오

4 표본 밖(OOS)에서도 살아남았는가?

왜: 과거에만 꺾맞춘(과최적화) 변수는 낯선 기간에서 무너진다. 숨긴 기간에서도 기댓값 $E > 0$ 인가.

☐ 예 ☐ 아니오

5 표본이 충분한가? (거래 200회+)

왜: 거래 30건짜리 '샤프 3'은 통계가 아니라 운. 표본이 적으면 좋은 수치도 우연일 수 있다.

☐ 예 ☐ 아니오

6 최악 낙폭(MDD)을 견딜 사이즈인가?

왜: 몬테카를로로 거래 순서를 섞어 95% 최악 MDD를 본다. 그 낙폭을 견딜 수 없으면 사이즈가 과하다.

☐ 예 ☐ 아니오

채점 - 몇 개를 '아니오'로 답했나?

'아니오' 0개: 드문 경우 - 이미 검증의 눈을 가졌습니다. 더 깊은 자동화·포트폴리오로 확장할 때.

'아니오' 1~2개: 위험 신호. 곡선의 수익 일부는 '거짓말'일 가능성이 큼니다. 빠진 관문부터 메우세요.

'아니오' 3개 이상: 당신의 백테스트는 사실상 '예쁜 거짓말'입니다. 실계좌에 넣기 전에 멈추세요.

그래서, 무엇을 하면 되나

이 6개는 우리 부트캠프 '검증' 단계의 핵심 관문입니다. 6주 과정에서 당신은 - ① 7요소 사양서로 AI에 정확히 시키고 ② 초안→룩어헤드 제거→비용→OOS로 진짜 수익을 발라내고 ③ 몬테카를로·하프 켈리로 사이즈를 낮추고 ④ 킬스위치·폐기 조건으로 운영합니다. 끝나면 검증된 나만의 트레이딩 시스템 + 검수 리포트가 손에 남습니다.

→ 6주, 검증된 나만의 트레이딩 시스템 완성

[커리큘럼 보기] [무료 맛보기 신청]

※ 본 자료와 과정은 수익을 보장하지 않습니다. 모든 예시 수치는 교육용 가상 데이터입니다.