

QUANT-BRIDGE by MILESTONE



PORTFOLIO

QUANT-BRIDGE

1. TREND-CORE 전략 성과 보고서

본 보고서는 백테스트 결과를 Chat-gpt를 활용하여 데이터 모델링으로 작성했습니다.

*본 자료는 과거 시뮬레이션 예시이며, 미래의 수익을 보장하지 않습니다.

전략 개요

1

전략명: TREND-CORE

낮은 변동성+추세추종



위험도

2

포트폴리오 구성품목

SOL, AVAX, KAS, MNT, AERO 등
(품목은 유동적으로 변동가능)



변동성

3

거래 타임프레임

30분 ~ 4시간



수익성

전략 성과 요약

항목	값
초기자본 (USDT)	10,000.0
심볼 수	6
타임프레임 조합 수	24
총 순익(USDT)	40,055.64
총 수익률 (%)	405.56%
MDD (USDT)	990.60
MDD (%)	11.75%
MDD 피크 시점	2025-08-18 05:00:00
MDD 바닥 시점	2025-08-29 05:00:00
회복 시점	미회복
거래수 (청산)	60,270
승률 (%)	75.87%
PROFIT FACTOR	1.620

기간 내 수익/손실 비중

구분	수익	손실	합계	수익비중(%)/손실비중(%)
월	30	2	32	93.75% / 6.25%
주	106	34	140	75.71% / 24.29%

월별 수익 (2023년)

16.0189%

2023-11 최고 월간 수익률
월간 수익률: 16.0189%

7.8066%

2025-03 최고 월간 손익금
월간 손익금: 2999.26 USDT

-0.3387%

2023-09 최저 월간 수익률
월간손익 : -50.187 USDT

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2023-01	10000.0	10956.155	960.5155	9.6515
2023-02	10965.155	11320.073	350.558	3.2428
2023-03	11320.073	11828.486	507.915	4.4866
2023-04	11828.486	11915.244	86.594	0.7321
2023-05	11915.244	12604.402	689.14	5.7838
2023-06	12604.402	13750.152	1145.75	9.0901
2023-07	13750.152	14359.884	609.732	4.4344
2023-08	14359.884	14817.175	458.29	3.1915
2023-09	14817.175	14767.988	-50.187	-0.3387
2023-10	14767.988	16361.242	1593.255	10.7886
2023-11	16361.242	18981.88	2620.883	16.0189
2023-12	18981.88	20460.304	1478.178	7.7872

월별 수익 (2024년)

16.0189%

2023-11 최고 월간 수익률
월간 수익률: 16.0189%

7.8066%

2025-03 최고 월간 손익금
월간 손익금: 2999.26 USDT

-0.3387%

2023-09 최저 월간 수익률
월간손익 : -50.187 USDT

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2024-01	20460.04	21579.88	1119.85	5.4733
2024-02	21579.88	22755.53	1175.662	5.4479
2024-03	22755.53	23082.12	326.59	1.4352
2024-04	23082.12	23787.81	70.57	3.0573
2024-05	23787.81	24251.05	463.24	1.9474
2024-06	24251.05	26267.28	2016.249	8.314
2024-07	26267.28	27655.01	1387.75	5.2831
2024-08	27655.01	29487.12	1832.147	6.6249
2024-09	29487.12	30713.7	122.6602	4.1597
2024-10	30713.7	32116.06	1402.362	4.5659
2024-11	32116.06	34200.23	2084.203	6.4895
2024-12	34200.23	34133.20	-67.03	-0.196

월별 수익 (2025년)

16.0189%

2023-11 최고 월간 수익률
월간 수익률: 16.0189%

7.8066%

2025-03 최고 월간 손익금
월간 손익금: 2999.26 USDT

-0.3387%

2023-09 최저 월간 수익률
월간손익 : -50.187 USDT

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2025-01	34133.20	36178.12	2044.92	5.991
2025-02	36178.12	38419.53	2241.457	6.1955
2025-03	38419.53	41418.79	2999.26	7.8066
2025-04	41418.79	43374.01	1955.251	4.7206
2025-05	43374.01	44625.87	1251.861	2.8862
2025-06	44625.87	46490.38	1864.53	4.1781
2025-07	46490.38	48740.39	2250.01	4.8397
2025-08	48740.39	50555.72	1815.34	3.7245

누적 손익 그래프

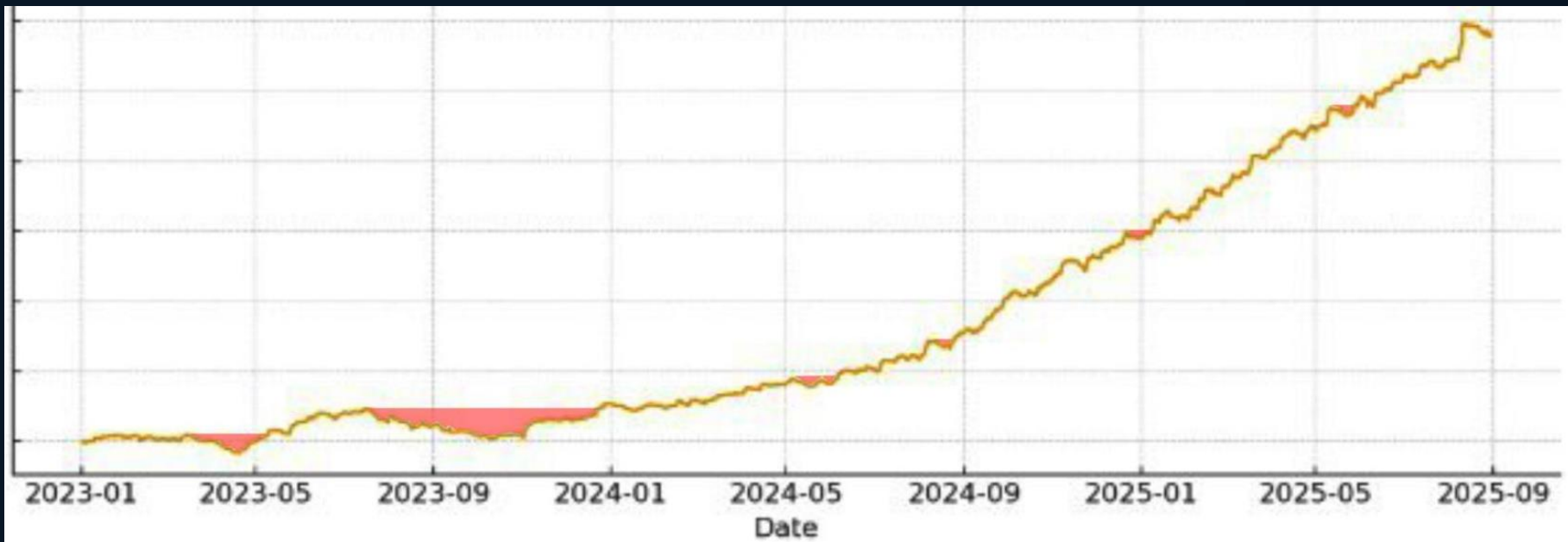


누적수익률 분석

위 그래프는 **TREND-CORE 전략**의 에퀴티 커브를 보여줍니다. 2023년 1월부터 2025년 8월까지 꾸준한 상승세를 보이고 있으며, 초기 자본 10,000 USDT에서 최종 50,555 USDT로 약 **405.56%**의 수익률을 달성했습니다.

*본 자료는 과거 시뮬레이션 예시이며, 미래의 수익을 보장하지 않습니다.

최대 손실폭



MDD 분석

TREND-CORE 전략은 최대 드로다운(MDD)이 11.75%로 매우 낮은 수준을 유지하고 있습니다. 이는 전략의 안정성을 보여주는 중요한 지표입니다. 월별 수익률 차트에서는 대부분의 월에서 양의 수익률을 기록했으며, 특히 2023년 11월과 2025년 3월에 높은 수익률을 달성했습니다.

*본 자료는 과거 시뮬레이션 예시이며, 미래의 수익을 보장하지 않습니다.