

QUANT-BRIDGE by MILESTONE



PORTFOLIO

QUANT-BRIDGE

4. TREND-ETF 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-ETF

시가총액상위 + ETF



위험도

2

포트폴리오 구성품목

SOL, AVAX, ADA, XRP 등
(품목은 유동적으로 변동가능)



변동성

3

거래 타임프레임

1시간 ~ 4시간



수익성

전략 성과 요약

항목	값
초기자본 (USDT)	10,000.0
심볼 수	4
타임프레임 조합 수	24
총 순익(USDT)	28,000.00
총 수익률 (%)	280.0%
MDD (USDT)	2800.00
MDD (%)	18.9%
MDD 피크 시점	2025-05-18 05:00:00
MDD 바닥 시점	2025-07-10 05:00:00
회복 시점	54일
거래수 (청산)	30,170
승률 (%)	62.37%
PROFIT FACTOR	1.850

기간 내 수익/손실 비중

구분	수익	손실	합계	수익비중(%) / 손실비중(%)
월	20	4	24	83.33% / 16.67%
주	96	56	40	58.70% / 41.30%

월별 수익 (2024년)

15.8%

2024-06 최고 월간 수익률
월간 수익률: 16%

15.8%

2024-06 최고 월간 손익금
월간 손익금: 2400USDT

-11.4%

2024-07 최저 월간 수익률
월간손익 : -2,000 USDT

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2024-01	10000.0	10900.00	900.00	9.0
2024-02	10900.00	12600.00	1,700.00	15.6
2024-03	12600.00	14200.00	1,600.00	12.7
2024-04	14200.000	13500.00	-700.00	-4.9
2024-05	13500.00	15200.00	1,700.00	12.6
2024-06	15200.00	17600.00	2,400.00	15.8
2024-07	17600.00	15600.00	-2,000.00	-11.4
2024-08	15600.00	16500.00	900.00	5.8
2024-09	16500.00	18200.00	1,700.00	10.3
2024-10	18200.00	19800.00	1,600.00	8.8
2024-11	19800.00	19000.00	-800.00	-4.0
2024-12	19000.00	20460.00	1,460.00	7.9

월별 수익 (2025년)

11.5%

2025-02 최고 월간 수익
률 월간 수익률: 11.5%

11.5%

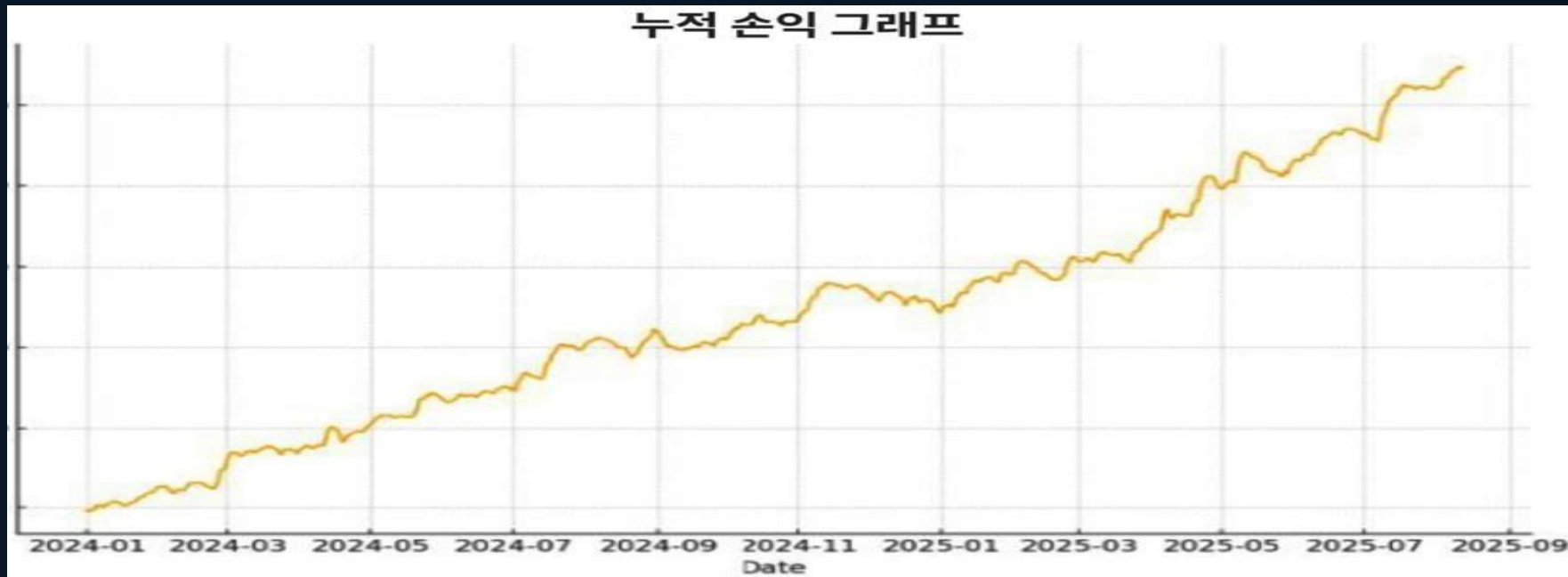
2025-02 최고 월간 손익금
월간 손익금: 2600.00 USDT

-10.9%

2023-09 최저 월간 수익률
월간손익 : -3400.00 USDT

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2025-01	20500.00	22600.00	2100.00	10.2
2025-02	22600.00	25200.00	2600.00	11.5
2025-03	25200.00	27800.00	2600.00	10.3
2025-04	27800.00	29300.00	1500.00	5.4
2025-05	29300.00	31200.00	1900.00	6.5
2025-06	31200.00	27800.00	-3400.00	-10.9
2025-07	27800.00	29800.00	2000.00	7.2
2025-08	29800.00	32200.00	2400.00	8.1
2025-09	32200.00	34500.00	2300.00	7.1
2025-10	34500.00	36200.00	1700.00	4.9
2025-11	36200.00	37200.00	1000.00	2.8
2025-12	37200.00	38000.00	800.00	2.2

누적 손익 그래프



누적수익률 분석

위 그래프는 **TREND-ETF 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-ETF 전략은 최대 드로다운(MDD)이 **18.9%**로 준수한 수준을 유지하고 있습니다.
이는 전략의 안정성을 보여주는 중요한 지표입니다. 월별 수익률 차트에서는 대부분의 월에서 양의 수익률을 기록했으며, 특히 **2024년 02월**과 **2025년 2월**에 높은 수익률을 달성했습니다.

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