

QUANT-BRIDGE by MILESTONE



PORTFOLIO

QUANT-BRIDGE

2. TREND-MOMENTUM 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-MOMENTUM

높은 변동성+추세추종



위험도

2

포트폴리오 구성품목

WIF, PEPE, FLOKI, GALA 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)	69,438
총 수익률 (%)	590%
MDD (USDT)	2,644
MDD (%)	14.60%
MDD 피크 시점	2025-08-18 05:00:00
MDD 바닥 시점	2025-08-29 09:00:00
회복 시점	미회복
거래수 (청산)	104,308
승률 (%)	57.07%
PROFIT FACTOR	1.630

기간 내 수익/손실 비중

구분	수익	손실	합계	수익비중(%) / 손실비중(%)
월	18	3	21	85.71% / 14.29%
주	61	27	88	69.32% / 30.68%

월별 수익 (2024년)

52.75%

2024-02 최고 월간 수익률
월간 수익률: 52.75%

-1%

2025-03 최저 월간 수익률
월간 수익률: -1%

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2024-01	9937.8	11191.6	1978.8	19.91
2024-02	11191.6	18202.0	6285.4	52.75
2024-03	18202.0	24215.0	6013.0	33.03
2024-04	24215.0	25779.1	1564.1	6.46
2024-05	25779.1	28017.2	2238.1	8.68
2024-06	28017.2	27821.4	-195.8	-0.70
2024-07	27821.4	31056.3	3234.9	11.63
2024-08	31056.3	34776.5	3720.2	11.98
2024-09	34776.5	36746.6	1970.1	5.66
2024-10	36746.6	37158.1	411.5	1.12
2024-11	37158.1	41976.4	4818.3	12.97
2024-12	41976.4	42261.8	285.4	0.68

월별 수익 (2025년)

52.75%

2024-02 최고 월간 수익률
월간 수익률: 52.75%

-1%

2025-03 최저 월간 수익률
월간 수익률: -1%

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2025-01	42261.8	47185.1	4923.2	11.65
2025-02	47185.1	52419.2	5234.2	11.09
2025-03	52419.2	51893.2	-526.0	-1.00
2025-04	51893.2	57518.3	5625.1	10.84
2025-05	57518.3	63571.4	6053.1	10.52
2025-06	63571.4	65147.1	1575.7	2.48
2025-07	65147.1	69438.9	4291.8	6.59
2025-08	69438.9	50557.9	-151.0	-0.22

누적 손익 그래프



누적수익률 분석

위 그래프는 **TREND-MOMENTUM 전략**의 에퀴티 커브를 보여줍니다. 2024년 1월부터 2025년 8월까지 꾸준한 상승세를 보이고 있으며, 초기 자본 10,000 USDT에서 최종 69,438.9 USDT로 약 **594.38%**의 수익률을 달성했습니다.

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

최대 손실폭



MDD 분석

TREND-MOMENTUM 전략은 최대 드로다운(MDD)이 **14.6%**로 적정 수준을 유지하고 있습니다. 이는 전략의 안정성을 보여주는 중요한 지표입니다. 월별 수익률 차트에서는 대부분의 월에서 양의 수익률을 기록했으며, 특히 **2024년 2월**과 **2024년 3월**에 높은 수익률을 달성했습니다.

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