

QUANT-BRIDGE by MILESTONE



PORTFOLIO

QUANT-BRIDGE

3. TREND-SWING 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-SWING

시가총액상위 + 추세추종 + 자산배분



위험도

2

포트폴리오 구성품목

BTC, ETH, SOL, PAXG
(품목은 유동적으로 변동가능)



변동성

3

거래 타임프레임

4시간 ~ 12시간



수익성

전략 성과 요약

항목	값
초기자본 (USDT)	10,000.00
심볼 수	4
타임프레임 조합 수	12
총 순익(USDT)	7,830
총 수익률 (%)	78.3%
MDD (USDT)	1700.60
MDD (%)	12.5%
MDD 피크 시점	2024-11-26 05:00:00
MDD 바닥 시점	2025-03-11 09:00:00
회복 시점	2025-05-08 (회복기간 58일)
거래수 (청산)	660
승률 (%)	46.36%
PROFIT FACTOR	2.02

기간 내 수익/손실 비중

구분	수익	손실	합계	수익비중(%) / 손실비중(%)
월	12	9	21	93.75% / 6.25%
주	88	56	32	75.71% / 24.29%

월별 수익 (2024년)

14.59%

2024-02 최고 월간 수익률
월간 수익률: 14.59%

-3.62%

2025-02 최저 월간 수익률
월간 수익률: -3.62%

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2024-01	10000.0	9997.5	-2.5	-0.02
2024-02	9997.5	11,311.6	1314.1	13.14
2024-03	11,311.6	12,961.4	1649.8	14.59
2024-04	12,961.4	12,893.6	-67.8	-0.52
2024-05	12,893.6	13,811.7	918.1	7.12
2024-06	13,811.7	113,585.5	-226.20	-1.63
2024-07	113,585.5	14,152.7	567.20	4.17
2024-08	14,152.7	13,910.5	-242.2	-1.71
2024-09	13,910.5	14,218.5	308.0	2.21
2024-10	14,218.5	14,522.5	304.0	2.14
2024-11	14,522.5	15,873.6	1,351.1	9.30
2024-12	15,873.6	15,388.8	-484.8	-3.05

월별 수익 (2025년)

52.75%

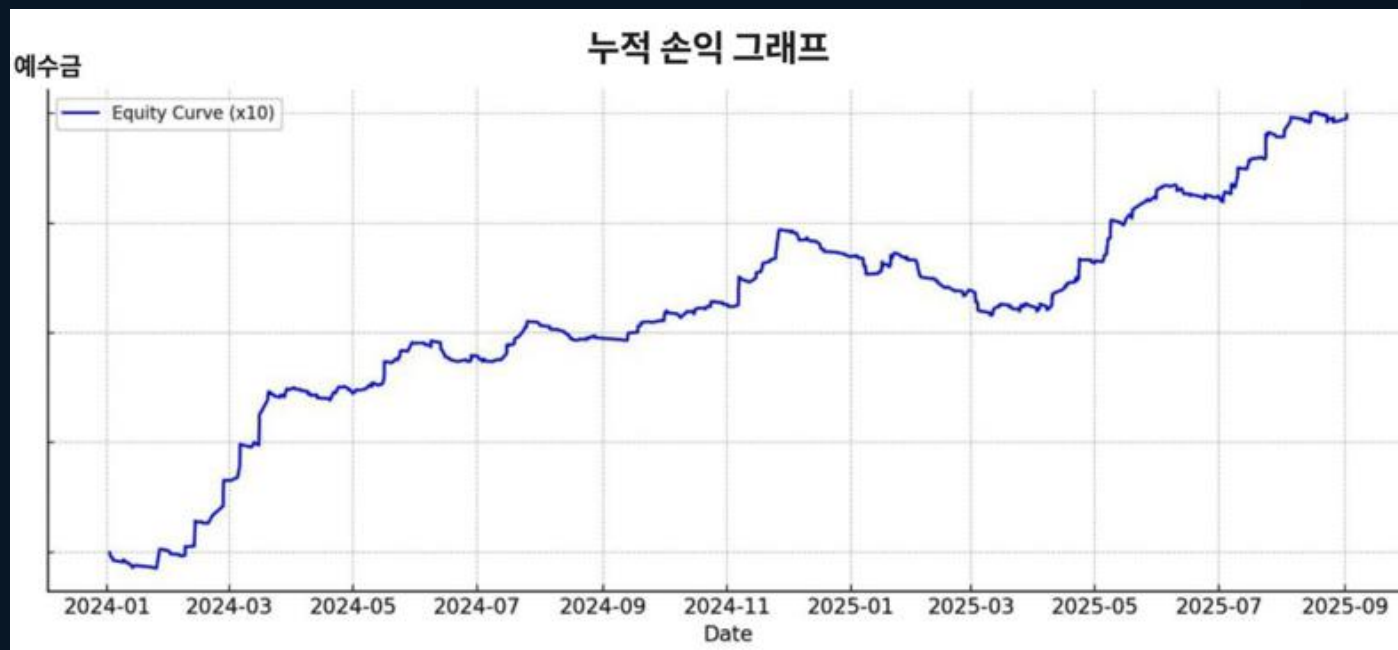
2024-02 최고 월간 수익률
월간 수익률: 52.75%

-1%

2025-03 최저 월간 수익률
월간 수익률: -1%

월	기간 시작자본	기간 종료자본	월간 손익(USDT)	월간 수익률(%)
2025-01	15,388.8	15,333.8	-55.0	-0.36
2025-02	15,333.8	14,779.2	-554.6	-3.62
2025-03	14,779.2	14,506.1	-273.10	-1.85
2025-04	14,506.1	15,268.1	762.0	5.25
2025-05	15,268.1	16,601.2	1,342.1	8.79
2025-06	16,601.2	16,500.3	-109.90	-0.66
2025-07	16,500.3	17,575.1	1074.80	6.51
2025-08	17,575.1	17,883.6	308.50	1.76

누적 손익 그래프



누적수익률 분석

위 그래프는 **TREND-SWING 전략**의 에퀴티 커브를 보여줍니다. 2024년 1월부터 2025년 8월까지 꾸준한 상승세를 보이고 있으며, 초기 자본 10,000 USDT에서 최종 17,883 USDT로 약 **78.3%**의 수익률을 달성했습니다.

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

최대 손실폭



MDD 분석

TREND-SWING 전략은 최대 드로다운(MDD)이 12.55%로 적정 수준을 유지하고 있습니다. 이는 전략의 안정성을 보여주는 중요한 지표입니다. 월별 수익률 차트에서는 대부분의 월에서 양의 수익률을 기록했으며, 특히 2024년 2월과 2024년 3월에 높은 수익률을 달성했습니다.

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