



시스템 성능 보고서

종목명(시스템명)  
주기(기간)

: Micro E-mini Nasdaq100-202403([System 1] 2 MOV)  
: 3분 (2024/01/24 ~ 2024/02/24)

| 구분   | 손익(pt) | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수  | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------|--------|---------|-----------|-------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 전체기간 | 746.00 | 1.24    | 0.82      | 307   | 60.26 | -198.25   | 84.92       | 0.38            |
| 일간평균 | 32.43  | 1.20    | 0.82      | 13.78 | 56.10 | -71.93    | 21.90       | 0.00            |

| ↓ 년/월/일    | 손익(pt)  | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------------|---------|---------|-----------|------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 2024/02/23 | 25.00   | 1.33    | 0.57      | 10   | 70.00 | -62.00    |             |                 |
| 2024/02/22 | -43.50  | 0.76    | 0.66      | 15   | 53.33 | -90.25    |             |                 |
| 2024/02/21 | 71.25   | 1.40    | 0.89      | 18   | 61.11 | -55.75    |             |                 |
| 2024/02/20 | -46.25  | 0.71    | 0.71      | 12   | 50.00 | -106.00   |             |                 |
| 2024/02/19 | -56.75  | 0.26    | 0.38      | 5    | 40.00 | -67.25    |             |                 |
| 2024/02/16 | 167.00  | 2.34    | 1.76      | 14   | 57.14 | -76.75    |             |                 |
| 2024/02/15 | -24.25  | 0.85    | 0.85      | 14   | 50.00 | -68.75    |             |                 |
| 2024/02/14 | -36.00  | 0.29    | 0.59      | 3    | 33.33 | -41.00    |             |                 |
| 2024/02/13 | 106.25  | 1.61    | 0.87      | 20   | 65.00 | -59.50    |             |                 |
| 2024/02/12 | -21.25  | 0.82    | 0.99      | 11   | 45.45 | -66.25    |             |                 |
| 2024/02/09 | 117.00  | 2.01    | 0.84      | 17   | 70.59 | -47.75    |             |                 |
| 2024/02/08 | -127.75 | 0.22    | 0.79      | 9    | 22.22 | -131.75   |             |                 |
| 2024/02/07 | 82.25   | 1.46    | 0.73      | 21   | 66.67 | -60.75    |             |                 |
| 2024/02/06 | 13.50   | 1.08    | 0.84      | 16   | 56.25 | -73.00    |             |                 |
| 2024/02/05 | -24.00  | 0.76    | 0.61      | 9    | 55.56 | -59.25    |             |                 |
| 2024/02/02 | 12.50   | 1.08    | 0.65      | 16   | 62.50 | -78.75    |             |                 |
| 2024/02/01 | 216.25  | 1.87    | 0.94      | 30   | 66.67 | -79.25    |             |                 |
| 2024/01/31 | 28.75   | 1.21    | 0.91      | 14   | 57.14 | -102.25   |             |                 |
| 2024/01/30 | 161.25  | 2.26    | 0.87      | 18   | 72.22 | -35.75    |             |                 |
| 2024/01/29 | 41.50   | 1.39    | 1.16      | 11   | 54.55 | -106.25   |             |                 |
| 2024/01/26 | -54.00  | 0.65    | 0.65      | 12   | 50.00 | -87.75    |             |                 |
| 2024/01/25 | 140.25  | 2.38    | 0.86      | 15   | 73.33 | -30.25    |             |                 |
| 2024/01/24 | -3.00   | 0.96    | 0.72      | 7    | 57.14 | -68.25    |             |                 |

종합

거래내역

기간분석

전략분석

수익손실거래

그래프

설정

시스템 성능 보고서

종목명(시스템명)  
주기(기간)

: Micro E-mini Nasdaq100-202403([System 1] 2 MOV)  
: 3분 (2024/01/25 ~ 2024/02/24)

| 구분   | 손익(pt) | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수  | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------|--------|---------|-----------|-------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 전체기간 | 803.00 | 1.26    | 0.83      | 302   | 60.26 | -198.25   | 86.81       | 0.42            |
| 일간평균 | 36.50  | 1.24    | 0.84      | 14.18 | 55.96 | -72.10    | 21.94       | 0.01            |

| ↓ 년/월/일    | 손익(pt)  | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------------|---------|---------|-----------|------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 2024/02/23 | 84.25   | 2.10    | 0.79      | 11   | 72.73 | -62.00    | 20.71       | 0.37            |
| 2024/02/22 | -43.50  | 0.76    | 0.66      | 15   | 53.33 | -90.25    | 21.19       | -0.14           |
| 2024/02/21 | 71.25   | 1.40    | 0.89      | 18   | 61.11 | -55.75    | 23.92       | 0.17            |
| 2024/02/20 | -46.25  | 0.71    | 0.71      | 12   | 50.00 | -106.00   | 22.76       | -0.17           |
| 2024/02/19 | -56.75  | 0.26    | 0.38      | 5    | 40.00 | -67.25    | 17.49       | -0.65           |
| 2024/02/16 | 167.00  | 2.34    | 1.76      | 14   | 57.14 | -76.75    | 30.85       | 0.39            |
| 2024/02/15 | -24.25  | 0.85    | 0.85      | 14   | 50.00 | -68.75    | 21.88       | -0.08           |
| 2024/02/14 | -36.00  | 0.29    | 0.59      | 3    | 33.33 | -41.00    | 19.09       | -0.63           |
| 2024/02/13 | 106.25  | 1.61    | 0.87      | 20   | 65.00 | -59.50    | 22.70       | 0.23            |
| 2024/02/12 | -21.25  | 0.82    | 0.99      | 11   | 45.45 | -66.25    | 20.61       | -0.09           |
| 2024/02/09 | 117.00  | 2.01    | 0.84      | 17   | 70.59 | -47.75    | 20.01       | 0.34            |
| 2024/02/08 | -127.75 | 0.22    | 0.79      | 9    | 22.22 | -131.75   | 18.40       | -0.77           |
| 2024/02/07 | 82.25   | 1.46    | 0.73      | 21   | 66.67 | -60.75    | 21.35       | 0.18            |
| 2024/02/06 | 13.50   | 1.08    | 0.84      | 16   | 56.25 | -73.00    | 23.62       | 0.04            |
| 2024/02/05 | -24.00  | 0.76    | 0.61      | 9    | 55.56 | -59.25    | 20.45       | -0.13           |
| 2024/02/02 | 12.50   | 1.08    | 0.65      | 16   | 62.50 | -78.75    | 22.34       | 0.03            |
| 2024/02/01 | 216.25  | 1.87    | 0.94      | 30   | 66.67 | -79.25    | 23.63       | 0.31            |
| 2024/01/31 | 28.75   | 1.21    | 0.91      | 14   | 57.14 | -102.25   | 21.81       | 0.09            |
| 2024/01/30 | 161.25  | 2.26    | 0.87      | 18   | 72.22 | -35.75    | 22.78       | 0.39            |
| 2024/01/29 | 41.50   | 1.39    | 1.16      | 11   | 54.55 | -106.25   | 24.84       | 0.15            |
| 2024/01/26 | -54.00  | 0.65    | 0.65      | 12   | 50.00 | -87.75    | 21.08       | -0.21           |
| 2024/01/25 | 135.00  | 2.26    | 1.03      | 16   | 68.75 | -30.25    | 21.17       | 0.40            |

종합

거래내역

기간분석

전략분석

수익손실거래

그래프

설정



시스템 성능 보고서

|   |         |         |           |      |        |           |             |                 |  |
|---|---------|---------|-----------|------|--------|-----------|-------------|-----------------|--|
| 종목명(시스템명) : Micro E-mini Nasdaq100-202403([System 2] 3 MOV DayOpen) |         |         |           |      |        |           |             |                 |  |
| 주기(기간) : 5분 (2024/01/04 ~ 2024/02/24)                               |         |         |           |      |        |           |             |                 |  |
| 주기  | 일간분석    | 방법      | 단위분석      |      |        |           |             |                 |  |
| 구분  | 손익(pt)  | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%)  | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |  |
| 전체기간  | 647.75  | 1.18    | 1.04      | 302  | 53.31  | -406.25   | 82.84       | 0.21            |  |
| 일간평균  | 17.05   | 1.04    | 0.85      | 7.97 | 53.11  | -71.66    | 20.52       | 0.21            |  |
| ↓ 년/월/일   | 손익(pt)  | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%)  | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |  |
| 2024/02/23  | 26.75   | 1.21    | 0.76      | 13   | 61.54  | -111.50   |             |                 |  |
| 2024/02/22  | -127.50 | 0       | 불능        | 5    | 0      | -122.00   |             |                 |  |
| 2024/02/21  | 37.00   | 2.45    | 1.23      | 3    | 66.67  | -21.25    |             |                 |  |
| 2024/02/20  | 7.00    | 1.08    | 1.08      | 6    | 50.00  | -50.00    |             |                 |  |
| 2024/02/19  | 3.75    | 1.15    | 0.57      | 3    | 66.67  | -25.75    |             |                 |  |
| 2024/02/16  | 85.50   | 불능      | 불능        | 1    | 100.00 | -2.25     |             |                 |  |
| 2024/02/15  | -127.50 | 0.17    | 1.00      | 7    | 14.29  | -127.25   |             |                 |  |
| 2024/02/14  | -127.50 | 0       | 불능        | 5    | 0      | -133.50   |             |                 |  |
| 2024/02/13  | 2.75    | 1.05    | 1.05      | 4    | 50.00  | -51.25    |             |                 |  |
| 2024/02/12  | 25.50   | 1.33    | 1.00      | 7    | 57.14  | -66.00    |             |                 |  |
| 2024/02/09  | 111.50  | 2.46    | 0.92      | 11   | 72.73  | -51.25    |             |                 |  |
| 2024/02/08  | -83.25  | 0.47    | 1.09      | 10   | 30.00  | -134.25   |             |                 |  |
| 2024/02/07  | -28.75  | 0.81    | 0.81      | 12   | 50.00  | -138.25   |             |                 |  |
| 2024/02/06  | 7.50    | 1.15    | 1.15      | 4    | 50.00  | -35.75    |             |                 |  |
| 2024/02/05  | -12.75  | 0.90    | 1.08      | 11   | 45.45  | -76.75    |             |                 |  |
| 2024/02/02  | 78.75   | 1.62    | 1.01      | 13   | 61.54  | -63.00    |             |                 |  |
| 2024/02/01  | 69.00   | 1.54    | 1.10      | 12   | 58.33  | -65.00    |             |                 |  |
| 2024/01/31  | 50.75   | 1.40    | 1.40      | 10   | 50.00  | -81.00    |             |                 |  |
| 2024/01/30  | 13.25   | 1.52    | 0.76      | 3    | 66.67  | -21.25    |             |                 |  |
| 2024/01/29  | 25.75   | 1.19    | 1.43      | 11   | 45.45  | -66.75    |             |                 |  |
| 2024/01/26  | -129.75 | 0.27    | 0.96      | 9    | 22.22  | -151.25   |             |                 |  |
| 2024/01/25  | -108.00 | 0.53    | 0.95      | 14   | 35.71  | -146.25   |             |                 |  |
| 2024/01/24  | 12.50   | 1.07    | 0.94      | 15   | 53.33  | -76.75    |             |                 |  |
| 2024/01/23  | -6.25   | 0.95    | 0.95      | 10   | 50.00  | -146.25   |             |                 |  |
| 2024/01/22  | -57.50  | 0.55    | 0.92      | 8    | 37.50  | -130.25   |             |                 |  |
| 2024/01/19  | 94.00   | 1.61    | 0.97      | 16   | 62.50  | -108.75   |             |                 |  |
| 2024/01/18  | 132.75  | 2.04    | 0.93      | 16   | 68.75  | -76.75    |             |                 |  |

종합 거래내역 기간분석 전략분석 수익손실거래 그래프 설정

시스템 성능 보고서

|   |         |         |           |      |        |           |             |                 |  |
|---|---------|---------|-----------|------|--------|-----------|-------------|-----------------|--|
| 종목명(시스템명) : Micro E-mini Nasdaq100-202403([System 2] 3 MOV DayOpen) |         |         |           |      |        |           |             |                 |  |
| 주기(기간) : 5분 (2024/01/04 ~ 2024/02/24)                               |         |         |           |      |        |           |             |                 |  |
| 주기  | 일간분석    | 방법      | 단위분석      |      |        |           |             |                 |  |
| 구분  | 손익(pt)  | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%)  | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |  |
| 전체기간  | 680.75  | 1.20    | 1.03      | 300  | 53.67  | -406.25   | 84.19       | 0.22            |  |
| 일간평균  | 18.40   | 1.04    | 0.81      | 8.14 | 53.82  | -72.81    | 20.46       | 0.21            |  |
| ↓ 년/월/일   | 손익(pt)  | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%)  | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |  |
| 2024/02/23  | 59.75   | 1.47    | 0.92      | 13   | 61.54  | -111.50   | 24.14       | 0.19            |  |
| 2024/02/22  | -127.50 | 0       | 불능        | 5    | 0      | -122.00   | 0           | 0               |  |
| 2024/02/21  | 37.00   | 2.45    | 1.23      | 3    | 66.67  | -21.25    | 27.13       | 0.45            |  |
| 2024/02/20  | 7.00    | 1.08    | 1.08      | 6    | 50.00  | -50.00    | 30.51       | 0.04            |  |
| 2024/02/19  | 3.75    | 1.15    | 0.57      | 3    | 66.67  | -25.75    | 19.37       | 0.06            |  |
| 2024/02/16  | 85.50   | 불능      | 불능        | 1    | 100.00 | -2.25     | 0           | 0               |  |
| 2024/02/15  | -127.50 | 0.17    | 1.00      | 7    | 14.29  | -127.25   | 17.85       | -1.02           |  |
| 2024/02/14  | -127.50 | 0       | 불능        | 5    | 0      | -133.50   | 0           | 0               |  |
| 2024/02/13  | 2.75    | 1.05    | 1.05      | 4    | 50.00  | -51.25    | 26.51       | 0.03            |  |
| 2024/02/12  | 25.50   | 1.33    | 1.00      | 7    | 57.14  | -66.00    | 25.81       | 0.14            |  |
| 2024/02/09  | 111.50  | 2.46    | 0.92      | 11   | 72.73  | -51.25    | 22.02       | 0.46            |  |
| 2024/02/08  | -83.25  | 0.47    | 1.09      | 10   | 30.00  | -134.25   | 22.38       | -0.37           |  |
| 2024/02/07  | -28.75  | 0.81    | 0.81      | 12   | 50.00  | -138.25   | 23.70       | -0.10           |  |
| 2024/02/06  | 7.50    | 1.15    | 1.15      | 4    | 50.00  | -35.75    | 27.40       | 0.07            |  |
| 2024/02/05  | -12.75  | 0.90    | 1.08      | 11   | 45.45  | -76.75    | 23.62       | -0.05           |  |
| 2024/02/02  | 78.75   | 1.62    | 1.01      | 13   | 61.54  | -63.00    | 25.52       | 0.24            |  |
| 2024/02/01  | 69.00   | 1.54    | 1.10      | 12   | 58.33  | -65.00    | 27.40       | 0.21            |  |
| 2024/01/31  | 50.75   | 1.40    | 1.40      | 10   | 50.00  | -81.00    | 31.35       | 0.16            |  |
| 2024/01/30  | 13.25   | 1.52    | 0.76      | 3    | 66.67  | -21.25    | 21.16       | 0.21            |  |
| 2024/01/29  | 25.75   | 1.19    | 1.43      | 11   | 45.45  | -66.75    | 28.96       | 0.08            |  |
| 2024/01/26  | -129.75 | 0.27    | 0.96      | 9    | 22.22  | -151.25   | 20.74       | -0.70           |  |
| 2024/01/25  | -108.00 | 0.53    | 0.95      | 14   | 35.71  | -146.25   | 24.04       | -0.32           |  |
| 2024/01/24  | 12.50   | 1.07    | 0.94      | 15   | 53.33  | -76.75    | 24.81       | 0.03            |  |
| 2024/01/23  | -6.25   | 0.95    | 0.95      | 10   | 50.00  | -146.25   | 24.99       | -0.03           |  |
| 2024/01/22  | -57.50  | 0.55    | 0.92      | 8    | 37.50  | -130.25   | 23.77       | -0.30           |  |
| 2024/01/19  | 94.00   | 1.61    | 0.97      | 16   | 62.50  | -108.75   | 24.64       | 0.24            |  |
| 2024/01/18  | 132.75  | 2.04    | 0.93      | 16   | 68.75  | -76.75    | 23.16       | 0.36            |  |

종합 거래내역 기간분석 전략분석 수익손실거래 그래프 설정

시스템 성능 보고서

종목명(시스템명)  
주기(기간)

: Micro E-mini Nasdaq100-202403([System 3] MOV\_MACD)  
: 5분 (2024/01/04 ~ 2024/02/24)

| 구분   | 손익(pt)   | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------|----------|---------|-----------|------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 전체기간 | 2,020.75 | 2.88    | 1.14      | 305  | 71.15 | -153.50   | 61.61       | 0.86            |
| 일간평균 | 53.18    | 14.27   | 2.69      | 8.08 | 66.28 | -31.76    | 14.29       | 0.53            |

| ↓ 년/월/일    | 손익(pt) | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%)  | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------------|--------|---------|-----------|------|--------|-----------|-------------|-----------------|
| 2024/02/23 | 12.00  | 1.50    | 1.50      | 4    | 50.00  | -24.50    |             |                 |
| 2024/02/22 | 46.00  | 2.48    | 0.62      | 10   | 80.00  | -44.50    |             |                 |
| 2024/02/21 | 164.00 | 27.24   | 2.10      | 14   | 92.86  | -15.50    |             |                 |
| 2024/02/20 | 30.75  | 1.37    | 1.83      | 7    | 42.86  | -48.75    |             |                 |
| 2024/02/19 | 12.25  | 7.13    | 1.43      | 6    | 83.33  | -5.75     |             |                 |
| 2024/02/16 | 105.25 | 2.45    | 3.26      | 7    | 42.86  | -52.50    |             |                 |
| 2024/02/15 | 83.00  | 4.95    | 0.90      | 13   | 84.62  | -21.25    |             |                 |
| 2024/02/14 | 79.50  | 5.68    | 1.26      | 11   | 81.82  | -12.00    |             |                 |
| 2024/02/13 | 96.00  | 3.34    | 1.67      | 6    | 66.67  | -27.25    |             |                 |
| 2024/02/12 | -23.25 | 0.43    | 0.43      | 4    | 50.00  | -26.00    |             |                 |
| 2024/02/09 | 122.50 | 6.00    | 4.00      | 5    | 60.00  | -26.75    |             |                 |
| 2024/02/08 | 13.75  | 1.34    | 0.89      | 5    | 60.00  | -35.75    |             |                 |
| 2024/02/07 | 130.00 | 3.52    | 1.76      | 9    | 66.67  | -23.00    |             |                 |
| 2024/02/06 | 86.50  | 5.12    | 1.46      | 9    | 77.78  | -10.75    |             |                 |
| 2024/02/05 | 51.50  | 2.45    | 1.75      | 12   | 58.33  | -31.50    |             |                 |
| 2024/02/02 | 32.75  | 3.91    | 1.12      | 9    | 77.78  | -88.25    |             |                 |
| 2024/02/01 | 52.75  | 5.31    | 1.99      | 11   | 72.73  | -17.75    |             |                 |
| 2024/01/31 | 10.25  | 9.20    | 4.60      | 3    | 66.67  | -27.00    |             |                 |
| 2024/01/30 | 93.00  | 19.60   | 3.92      | 6    | 83.33  | -11.75    |             |                 |
| 2024/01/29 | -4.25  | 0.93    | 1.86      | 6    | 33.33  | -64.25    |             |                 |
| 2024/01/26 | 36.25  | 5.53    | 1.38      | 11   | 72.73  | -25.50    |             |                 |
| 2024/01/25 | 10.75  | 1.25    | 0.55      | 13   | 69.23  | -41.75    |             |                 |
| 2024/01/24 | 58.75  | 1.92    | 1.53      | 9    | 55.56  | -40.25    |             |                 |
| 2024/01/23 | 86.50  | 불능      | 불능        | 13   | 100.00 | -20.25    |             |                 |
| 2024/01/22 | 56.25  | 2.77    | 1.01      | 15   | 73.33  | -33.50    |             |                 |
| 2024/01/19 | -27.50 | 0.25    | 0.38      | 5    | 40.00  | -45.75    |             |                 |
| 2024/01/18 | 75.50  | 불능      | 불능        | 7    | 100.00 | -36.25    |             |                 |

종합

거래내역

기간분석

전략분석

수익손실거래

그래프

설정

시스템 성능 보고서

종목명(시스템명)  
주기(기간)

: Micro E-mini Nasdaq100-202403([System 3] MOV\_MACD)  
: 5분 (2024/01/04 ~ 2024/02/24)

| 구분   | 손익(pt)   | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------|----------|---------|-----------|------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 전체기간 | 1,927.00 | 2.90    | 1.14      | 297  | 71.38 | -153.50   | 61.80       | 0.84            |
| 일간평균 | 52.08    | 14.59   | 2.73      | 8.08 | 68.94 | -30.96    | 13.92       | 0.54            |

| ↓ 년/월/일    | 손익(pt) | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%)  | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------------|--------|---------|-----------|------|--------|-----------|-------------|-----------------|
| 2024/02/23 | 21.00  | 1.88    | 1.88      | 4    | 50.00  | -24.50    | 20.37       | 0.26            |
| 2024/02/22 | 46.00  | 2.48    | 0.62      | 10   | 80.00  | -44.50    | 12.62       | 0.36            |
| 2024/02/21 | 164.00 | 27.24   | 2.10      | 14   | 92.86  | -15.50    | 11.02       | 1.06            |
| 2024/02/20 | 30.75  | 1.37    | 1.83      | 7    | 42.86  | -48.75    | 28.96       | 0.15            |
| 2024/02/19 | 12.25  | 7.13    | 1.43      | 6    | 83.33  | -5.75     | 2.49        | 0.82            |
| 2024/02/16 | 105.25 | 2.45    | 3.26      | 7    | 42.86  | -52.50    | 46.68       | 0.32            |
| 2024/02/15 | 83.00  | 4.95    | 0.90      | 13   | 84.62  | -21.25    | 12.44       | 0.51            |
| 2024/02/14 | 79.50  | 5.68    | 1.26      | 11   | 81.82  | -12.00    | 10.75       | 0.67            |
| 2024/02/13 | 96.00  | 3.34    | 1.67      | 6    | 66.67  | -27.25    | 25.81       | 0.62            |
| 2024/02/12 | -23.25 | 0.43    | 0.43      | 4    | 50.00  | -26.00    | 14.80       | -0.39           |
| 2024/02/09 | 122.50 | 6.00    | 4.00      | 5    | 60.00  | -26.75    | 31.52       | 0.78            |
| 2024/02/08 | 13.75  | 1.34    | 0.89      | 5    | 60.00  | -35.75    | 22.37       | 0.12            |
| 2024/02/07 | 130.00 | 3.52    | 1.76      | 9    | 66.67  | -23.00    | 26.26       | 0.55            |
| 2024/02/06 | 86.50  | 5.12    | 1.46      | 9    | 77.78  | -10.75    | 17.41       | 0.55            |
| 2024/02/05 | 51.50  | 2.45    | 1.75      | 12   | 58.33  | -31.50    | 17.50       | 0.25            |
| 2024/02/02 | 32.75  | 3.91    | 1.12      | 9    | 77.78  | -88.25    | 6.88        | 0.53            |
| 2024/02/01 | 52.75  | 5.31    | 1.99      | 11   | 72.73  | -17.75    | 8.87        | 0.54            |
| 2024/01/31 | 10.25  | 9.20    | 4.60      | 3    | 66.67  | -27.00    | 3.60        | 0.95            |
| 2024/01/30 | 93.00  | 19.60   | 3.92      | 6    | 83.33  | -11.75    | 16.96       | 0.91            |
| 2024/01/29 | -4.25  | 0.93    | 1.86      | 6    | 33.33  | -64.25    | 27.49       | -0.03           |
| 2024/01/26 | 36.25  | 5.53    | 1.38      | 11   | 72.73  | -25.50    | 6.31        | 0.52            |
| 2024/01/25 | 10.75  | 1.25    | 0.55      | 13   | 69.23  | -41.75    | 10.86       | 0.08            |
| 2024/01/24 | 58.75  | 1.92    | 1.53      | 9    | 55.56  | -40.25    | 23.08       | 0.28            |
| 2024/01/23 | 86.50  | 불능      | 불능        | 13   | 100.00 | -20.25    | 5.50        | 1.21            |
| 2024/01/22 | 56.25  | 2.77    | 1.01      | 15   | 73.33  | -33.50    | 10.98       | 0.34            |
| 2024/01/19 | -27.50 | 0.25    | 0.38      | 5    | 40.00  | -45.75    | 9.85        | -0.56           |
| 2024/01/18 | 75.50  | 불능      | 불능        | 7    | 100.00 | -36.25    | 3.81        | 2.83            |

종합

거래내역

기간분석

전략분석

수익손실거래

그래프

설정



시스템 성능 보고서

종목명(시스템명)  
주기(기간)

Micro E-mini Nasdaq100-202403([202402] 2 Data 2 MOV)  
5분 (2024/01/04 ~ 2024/02/24)

주기  
일간분석  
방법  
단위분석

| 구분   | 손익(pt) | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------|--------|---------|-----------|------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 전체기간 | 826.50 | 1.28    | 1.62      | 195  | 44.10 | -500.00   | 105.07      | 0.21            |
| 일간평균 | 22.34  | 2.05    | 1.56      | 5.30 | 38.39 | -69.16    | 27.44       | 0.01            |

↓ 년/월/일

| 손익(pt)     | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수  | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------------|---------|-----------|-------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 2024/02/23 | 0       | 불능        | 불능    | 0     | 0         | 0           |                 |
| 2024/02/22 | 292.25  | 10.58     | 1.76  | 7     | 85.71     | -24.75      |                 |
| 2024/02/21 | 115.25  | 1.94      | 1.56  | 9     | 55.56     | -82.25      |                 |
| 2024/02/20 | 139.75  | 2.15      | 1.72  | 9     | 55.56     | -62.00      |                 |
| 2024/02/19 | -32.75  | 0.10      | 0.19  | 3     | 33.33     | -29.50      |                 |
| 2024/02/16 | 97.25   | 2.06      | 1.55  | 7     | 57.14     | -86.75      |                 |
| 2024/02/15 | 7.50    | 1.06      | 1.42  | 7     | 42.86     | -92.25      |                 |
| 2024/02/14 | -26.50  | 0.13      | 0.13  | 2     | 50.00     | -36.75      |                 |
| 2024/02/13 | 124.00  | 1.81      | 1.51  | 11    | 54.55     | -63.25      |                 |
| 2024/02/12 | -30.50  | 0         | 불능    | 1     | 0         | -45.75      |                 |
| 2024/02/09 | 173.50  | 6.10      | 3.05  | 6     | 66.67     | -38.50      |                 |
| 2024/02/08 | -61.50  | 0         | 불능    | 3     | 0         | -60.00      |                 |
| 2024/02/07 | 35.00   | 1.29      | 1.29  | 8     | 50.00     | -91.75      |                 |
| 2024/02/06 | -122.00 | 0         | 불능    | 4     | 0         | -113.50     |                 |
| 2024/02/05 | -28.00  | 0.08      | 0.08  | 2     | 50.00     | -42.50      |                 |
| 2024/02/02 | 6.50    | 1.05      | 1.40  | 7     | 42.86     | -64.75      |                 |
| 2024/02/01 | -122.00 | 0         | 불능    | 4     | 0         | -123.00     |                 |
| 2024/01/31 | -105.50 | 0.32      | 1.94  | 7     | 14.29     | -105.00     |                 |
| 2024/01/30 | 13.00   | 1.20      | 1.80  | 5     | 40.00     | -70.00      |                 |
| 2024/01/29 | -11.75  | 0.82      | 2.47  | 4     | 25.00     | -61.25      |                 |
| 2024/01/26 | -13.50  | 0.85      | 1.28  | 5     | 40.00     | -91.75      |                 |
| 2024/01/25 | -61.00  | 0         | 불능    | 2     | 0         | -51.50      |                 |
| 2024/01/24 | 144.25  | 3.36      | 1.68  | 6     | 66.67     | -36.25      |                 |
| 2024/01/23 | 3.50    | 1.06      | 2.11  | 3     | 33.33     | -87.50      |                 |
| 2024/01/22 | 49.50   | 14.20     | 14.20 | 2     | 50.00     | -19.50      |                 |
| 2024/01/19 | 195.75  | 7.42      | 1.48  | 6     | 83.33     | -44.25      |                 |
| 2024/01/18 | 230.25  | 4.77      | 1.59  | 8     | 75.00     | -55.75      |                 |

종합 거래내역 기간분석 전략분석 수익손실거래 그래프 설정

시스템 성능 보고서

종목명(시스템명)  
주기(기간)

Micro E-mini Nasdaq100-202403([202402] 2 Data 2 MOV)  
5분 (2024/01/04 ~ 2024/02/24)

주기  
일간분석  
방법  
단위분석

| 구분   | 손익(pt) | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수 | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------|--------|---------|-----------|------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 전체기간 | 822.50 | 1.28    | 1.65      | 195  | 43.59 | -500.00   | 105.13      | 0.21            |
| 일간평균 | 22.23  | 2.05    | 1.60      | 5.30 | 37.94 | -69.16    | 27.43       | 0.01            |

↓ 년/월/일

| 손익(pt)     | 총수익/총손실 | 평균수익/평균손실 | 거래횟수  | 승률(%) | 최대손실폭(pt) | 기간 표준편차(pt) | 기간 Sharpe Ratio |
|------------|---------|-----------|-------|-------|-----------|-------------|-----------------|
| 2024/02/23 | 0       | 불능        | 불능    | 0     | 0         | 0           | 0               |
| 2024/02/22 | 292.25  | 10.58     | 1.76  | 7     | 85.71     | -24.75      | 29.78           |
| 2024/02/21 | 115.25  | 1.94      | 1.56  | 9     | 55.56     | -82.25      | 39.59           |
| 2024/02/20 | 139.75  | 2.15      | 1.72  | 9     | 55.56     | -62.00      | 41.27           |
| 2024/02/19 | -32.75  | 0.10      | 0.19  | 3     | 33.33     | -29.50      | 14.35           |
| 2024/02/16 | 97.25   | 2.06      | 1.55  | 7     | 57.14     | -86.75      | 39.82           |
| 2024/02/15 | 7.50    | 1.06      | 1.42  | 7     | 42.86     | -92.25      | 38.03           |
| 2024/02/14 | -26.50  | 0.13      | 0.13  | 2     | 50.00     | -36.75      | 17.25           |
| 2024/02/13 | 124.00  | 1.81      | 1.51  | 11    | 54.55     | -63.25      | 41.03           |
| 2024/02/12 | -30.50  | 0         | 불능    | 1     | 0         | -45.75      | 0               |
| 2024/02/09 | 173.50  | 6.10      | 3.05  | 6     | 66.67     | -38.50      | 33.41           |
| 2024/02/08 | -61.50  | 0         | 불능    | 3     | 0         | -60.00      | 14.14           |
| 2024/02/07 | 35.00   | 1.29      | 1.29  | 8     | 50.00     | -91.75      | 40.38           |
| 2024/02/06 | -122.00 | 0         | 불능    | 4     | 0         | -113.50     | 0               |
| 2024/02/05 | -28.00  | 0.08      | 0.08  | 2     | 50.00     | -42.50      | 16.50           |
| 2024/02/02 | 6.50    | 1.05      | 1.40  | 7     | 42.86     | -64.75      | 37.35           |
| 2024/02/01 | -122.00 | 0         | 불능    | 4     | 0         | -123.00     | 0               |
| 2024/01/31 | -105.50 | 0.32      | 1.94  | 7     | 14.29     | -105.00     | 28.28           |
| 2024/01/30 | 13.00   | 1.20      | 1.80  | 5     | 40.00     | -70.00      | 36.30           |
| 2024/01/29 | -11.75  | 0.82      | 2.47  | 4     | 25.00     | -61.25      | 34.62           |
| 2024/01/26 | -13.50  | 0.85      | 1.28  | 5     | 40.00     | -91.75      | 35.18           |
| 2024/01/25 | -61.00  | 0         | 불능    | 2     | 0         | -51.50      | 0               |
| 2024/01/24 | 144.25  | 3.36      | 1.68  | 6     | 66.67     | -36.25      | 38.62           |
| 2024/01/23 | 3.50    | 1.06      | 2.11  | 3     | 33.33     | -87.50      | 44.78           |
| 2024/01/22 | 49.50   | 14.20     | 14.20 | 2     | 50.00     | -19.50      | 28.50           |
| 2024/01/19 | 195.75  | 7.42      | 1.48  | 6     | 83.33     | -44.25      | 29.83           |
| 2024/01/18 | 230.25  | 4.77      | 1.59  | 8     | 75.00     | -55.75      | 36.47           |

종합 거래내역 기간분석 전략분석 수익손실거래 그래프 설정