

시스템 성능 개선 안내

Golden Egg Investment co, ltd

종목명	종합	연결_E-mini S&P500-20180903	결_E-mini Nasdaq100-20180903	연결_E-mini S&P500-20180628	결_E-mini Nasdaq100-20180628
시스템명		g_최종판_공격형_20180903	g_나스닥_공격형_20180903	g_최종판_공격형_20180628	g_나스닥_공격형_20180628
주기		60 분	60 분	60 분	60 분
시작일	2016/12/22	2016/12/28	2016/12/22	2016/12/28	2016/12/22
종료일	2018/09/01	2018/09/01	2018/09/01	2018/09/01	2018/09/01
총손익	189,302.50	56,012.50	57,460.00	36,450.00	39,380.00
미청산포함총손익	189,672.50	56,012.50	57,645.00	36,450.00	39,565.00
총수익	205,820.00	56,775.00	63,210.00	40,825.00	45,010.00
총손실	-16,517.50	-762.50	-5,750.00	-4,375.00	-5,630.00
연평균 수익	111,624.25	33,351.65	33,881.91	21,703.51	23,220.84
총거래 횟수	297	83	78	74	62
수익거래 횟수	261	74	70	62	55
손실거래 횟수	35	9	8	11	7
승률(%)	87	89.16	89.74	83.78	88.71
평균수익	637.38	674.85	736.67	492.57	635.16
평균손익비	1.67	9.06	1.26	1.66	1.02
최대수익	5,100.00	3,862.50	5,100.00	3,862.50	5,100.00
평균수익	788.58	767.23	903.00	658.47	818.36
최대연속 수익거래 횟수	48	48	27	21	17
수익거래 평균 봉 개수	25	25	23	32	21
최대손실	-2,295.00	-137.50	-2,295.00	-1,800.00	-2,295.00
평균손실	-471.93	-84.72	-718.75	-397.73	-804.29
최대연속 손실거래 횟수	3	3	2	2	1
손실거래 평균 봉 개수	48	80	26	53	23
최대손실폭	-9,312.50	-2,262.50	-5,555.00	-2,437.50	-5,555.00
보상비율	20.33	24.76	10.34	14.95	7.09
총수익/총손실	12.46	74.46	10.99	9.33	7.99
투자요구금액	431,717.50	114,475.00	104,545.00	114,650.00	104,545.00
수익률(%)	43.85	48.93	54.96	31.79	37.67

기존로직

튜닝 1. 반복 손절 로직 부분
튜닝작업으로 추후 같은 손실 방지

튜닝 2. 상승세 진입하는데 우리는 내려놓고
올라가는 거래(8월)착안,
신규로직 추가(3~4개)로 수익성 개선

결과 : S&P, NASDAQ 시스템 모두
55% 수익성 개선됨

시스템당 1년 기대수익

2만~2.3만불에서 3.3만불로 상승함.

시스템 성능 개선 안내

Golden Egg Investment co, ltd

종목명	합계	평균	-mini S&P500	-ini Nasdaq10	-mini S&P500	-ini Nasdaq10
시스템명			월_20180903	월_20180903	월_20180628	월_20180628
평균	9,032.02	2,258.01	2,667.26	2,745.00	1,735.71	1,884.05
표준편차	5,764.93	1,755.84	1,921.76	1,789.35	1,498.01	1,814.23
Sharpe Ratio	1.57	1.28	1.39	1.53	1.16	1.04
년/월	합계	평균	-mini S&P500	-ini Nasdaq10	-mini S&P500	-ini Nasdaq10
2018/08	9,682.50	2,420.63	5,650.00	3,900.00	-637.50	770.00
2018/07	22,355.00	5,588.75	4,300.00	7,090.00	3,875.00	7,090.00
2018/06	6,447.50	1,611.88	1,425.00	1,835.00	1,237.50	1,950.00
2018/05	10,100.00	2,525.00	3,750.00	3,010.00	2,225.00	1,115.00
2018/04	20,482.50	5,120.63	5,762.50	4,485.00	5,750.00	4,485.00
2018/03	11,625.00	2,906.25	5,725.00	3,235.00	3,125.00	-460.00
2018/02	19,960.00	4,990.00	5,725.00	4,955.00	4,325.00	4,955.00
2018/01	7,365.00	1,841.25	4,887.50	1,045.00	387.50	1,045.00
2017/12	14,242.50	3,560.63	2,925.00	6,030.00	1,262.50	5,045.00
2017/11	4,402.50	1,100.63	512.50	2,420.00	575.00	895.00
2017/10	6,180.00	1,545.00	1,450.00	1,875.00	1,325.00	1,530.00
2017/09	5,307.50	1,326.88	1,337.50	1,660.00	650.00	1,660.00
2017/08	6,877.50	1,719.38	1,837.50	1,925.00	1,850.00	1,265.00
2017/07	11,357.50	2,839.38	1,950.00	3,670.00	2,212.50	3,525.00
2017/06	3,007.50	751.88	862.50	135.00	1,875.00	135.00
2017/05	9,242.50	2,310.63	2,512.50	4,005.00	1,450.00	1,275.00
2017/04	3,942.50	985.63	937.50	990.00	1,125.00	890.00
2017/03	6,750.00	1,687.50	1,825.00	2,225.00	1,475.00	1,225.00
2017/02	6,095.00	1,523.75	2,550.00	815.00	2,275.00	455.00
2017/01	2,045.00	511.25	-225.00	1,550.00	-225.00	945.00
2016/12	2,205.00	551.25	312.50	790.00	312.50	790.00

월 평균 기대수익 상승

빨간 표시는 기존 대비 개선된 결과임

2계약 거래시 월 평균 5,400불 수익 예상

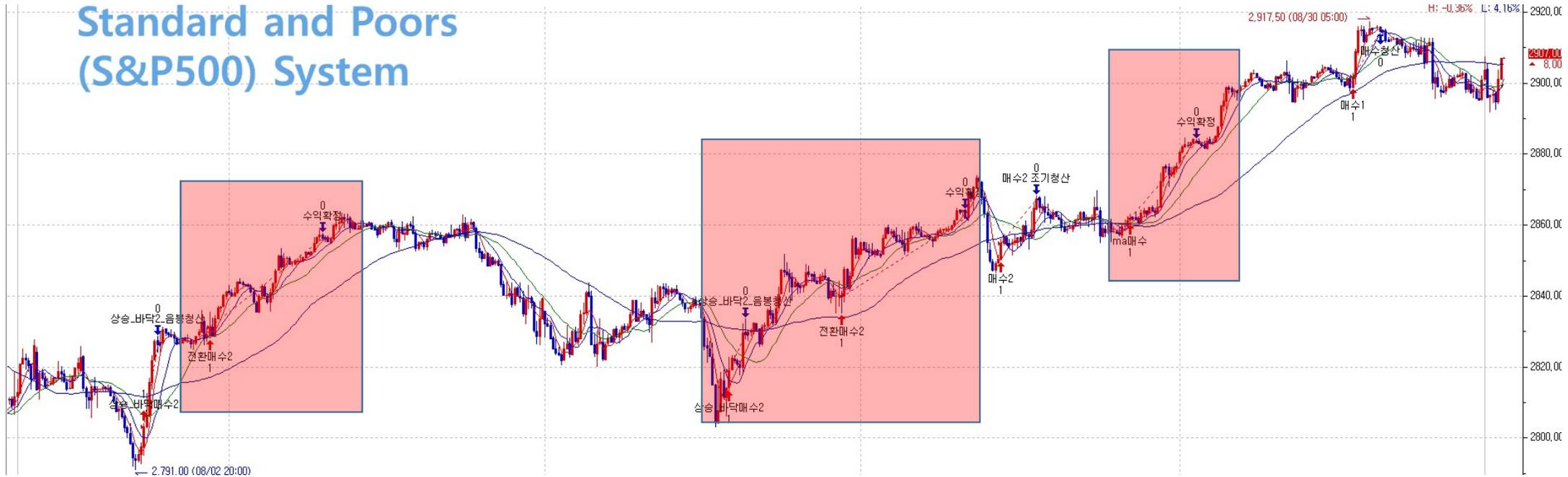
약 600만원

기존로직

시스템 성능 개선 안내

Golden Egg Investment co, ltd

Standard and Poors (S&P500) System



상승 구간 올라타는 매수 로직 추가 구현 (4가지 로직 추가 됨)

손절 발생한 로직 튜닝으로 추후 동일 로직 성립시 미진입하도록 조치함

시스템 성능 개선 안내

Golden Egg Investment co, ltd

NASDAQ 100 System



시스템 성능 개선 안내

Golden Egg Investment co, Ltd

진입일시	진입종류	진입명	진입가격(pt)	수량
청산일시	청산종류	청산명	청산가격(pt)	수익(pt)
2018/04/04 22:00	매수	상승_바닥매수1	2,578.00	1
2018/04/05 15:00	매수청산	상승바닥_졸업먹	2,655.50	77.25
2018/04/09 23:00	매수	분봉바닥매수2	2,625.50	1
2018/04/10 20:00	매수청산	수익확정	2,647.00	21.25
2018/05/02 03:00	매수	하락세_매수	2,638.75	1
2018/05/02 10:00	매수청산	하락세매수_졸업먹	2,649.50	10.50
2018/05/05 00:00	매수	하락세상승_선제매수	2,645.25	1
2018/05/07 11:00	매수청산	수익확정	2,668.25	22.75
2018/05/09 00:00	매수	전환매수3	2,665.25	1
2018/05/09 21:00	매수청산	매수청산	2,679.75	14.25
2018/05/15 17:00	매수	매수1	2,726.25	1
2018/05/22 22:00	매수청산	매수청산	2,737.25	10.75
2018/05/29 23:00	매수	상승_바닥매수2	2,706.75	1
2018/05/31 05:00	매수청산	상승_바닥2_음봉청산	2,723.75	16.75
2018/06/08 05:00	매수	매수1	2,770.00	1
2018/06/12 05:00	매수청산	매수청산	2,782.75	12.50
2018/06/19 21:00	매수	상승_바닥매수2	2,751.25	1
2018/06/20 02:00	매수청산	상승_바닥2_음봉청산	2,758.50	7.00
2018/06/26 07:00	매수	상승_바닥매수2	2,722.50	1
2018/06/27 04:00	매수청산	상승_바닥2_음봉청산	2,731.75	9.00

진입일시	진입종류	진입명	진입가격(pt)	수량
청산일시	청산종류	청산명	청산가격(pt)	수익(pt)
2018/07/02 09:00	매수	하락세_매수	2,722.75	1
2018/07/03 23:00	매수청산	매수청산	2,734.00	11.00
2018/07/06 22:00	매수	상승_바닥매수1	2,737.75	1
2018/07/09 14:00	매수청산	수익확정	2,772.50	34.50
2018/07/11 12:00	매수	매수2	2,778.00	1
2018/07/12 20:00	매수청산	매수2 조기청산	2,791.00	12.75
2018/07/17 02:00	매수	매수1	2,802.00	1
2018/07/18 12:00	매수청산	매수_졸업먹	2,814.75	12.50
2018/07/26 00:00	매수	전환매수1	2,821.00	1
2018/07/26 08:00	매수청산	전환매수_졸업먹	2,836.50	15.25
2018/08/02 23:00	매수	상승_바닥매수2	2,803.25	1
2018/08/03 04:00	매수청산	상승_바닥2_음봉청산	2,826.25	22.75
2018/08/04 00:00	매수	전환매수2	2,831.25	1
2018/08/07 08:00	매수청산	전환매수_졸업먹	2,849.25	17.75
2018/08/16 05:00	매수	상승_바닥매수2	2,819.00	1
2018/08/16 12:00	매수청산	상승_바닥2_음봉청산	2,829.00	9.75
2018/08/18 00:00	매수	전환매수2	2,839.75	1
2018/08/20 20:00	매수청산	전환매수_졸업먹	2,856.75	16.75
2018/08/22 12:00	매수	매수2	2,854.75	1
2018/08/23 01:00	매수청산	매수2 조기청산	2,867.25	12.25
2018/08/24 13:00	매수	ma매수	2,862.00	1
2018/08/27 14:00	매수청산	수익확정	2,883.50	21.25
2018/08/29 23:00	매수	매수1	2,901.75	1
2018/08/30 09:00	매수청산	매수_졸업먹	2,914.50	12.50

추가 로직 과거 기록 및 튜닝작업 이후 성능 기록