

业绩走势

累计收益

67.48%

年化收益 16.97%

最大回撤 24.73%

初始资金 10000000.00

总资产 16747991.03

起始时间 2016-01-04

终止时间 2019-05-30



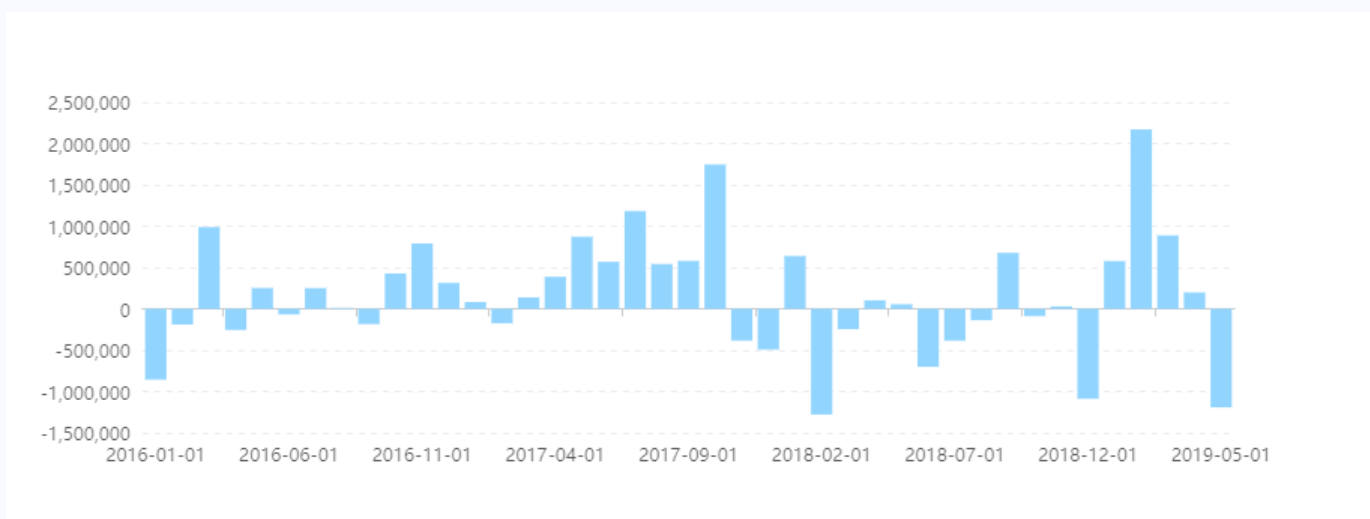
策略详情

策略信息									
策略名称	年化收益率	基准收益率	阿尔法	贝塔	夏普比率	信息比率	最大回撤	换手率	回测时间
Adaboost	16.97%	4.96%	0.16	0.67	0.80	1.20	24.73%	517.31%	2016-01-04~2019-05-30

周期分析

月周期分析						
月份	净利	净利率	毛利	毛损	交易次数	胜率
2016-01	-856098.53	-8.56%	1133373.07	1989471.60	0	0.00%
2016-02	-189699.15	-2.07%	0.00	189699.15	5	0.00%
2016-03	987797.03	11.03%	2095967.60	1108170.57	0	0.00%
2016-04	-256182.17	-2.58%	987346.26	1243528.43	3	100.00%
2016-05	252600.26	2.61%	1102200.41	849600.15	4	75.00%
2016-06	-67217.32	-0.68%	1115334.58	1182551.91	7	57.14%
2016-07	250383.39	2.54%	1688557.15	1438173.77	3	66.67%
2016-08	12163.41	0.12%	932146.60	919983.20	6	50.00%
2016-09	-184852.53	-1.82%	337324.48	522177.01	5	80.00%
2016-10	428235.12	4.30%	944367.20	516132.08	5	80.00%
2016-11	790212.28	7.61%	1531459.09	741246.81	2	100.00%

2016-12	313505.98	2.81%	1939871.86	1626365.88	1	100.00%
2017-01	82498.25	0.72%	1261974.02	1179475.77	6	33.33%
2017-02	-175258.93	-1.52%	449077.46	624336.40	5	80.00%
2017-03	137941.12	1.21%	997184.78	859243.66	5	80.00%
2017-04	387233.05	3.36%	1021597.30	634364.25	6	50.00%
2017-05	871968.04	7.32%	1671926.87	799958.83	4	75.00%
2017-06	568775.50	4.45%	1636787.16	1068011.65	3	100.00%
2017-07	1182448.08	8.85%	2424056.65	1241608.57	2	100.00%
2017-08	541812.06	3.73%	2457675.59	1915863.53	2	100.00%
2017-09	579714.50	3.84%	1591244.79	1011530.29	6	83.33%
2017-10	1746037.94	11.15%	3366639.51	1620601.57	9	77.78%
2017-11	-384437.61	-2.21%	3184847.56	3569285.17	3	66.67%
2017-12	-492438.65	-2.89%	1445798.00	1938236.65	5	100.00%
2018-01	638689.06	3.86%	3053189.08	2414500.02	6	50.00%
2018-02	-1279403.86	-7.45%	1342544.79	2621948.65	5	60.00%
2018-03	-245672.72	-1.55%	273286.39	518959.11	5	40.00%
2018-04	102789.27	0.66%	2291836.30	2189047.03	1	0.00%
2018-05	55483.19	0.35%	92143.67	36660.48	5	60.00%
2018-06	-702152.84	-4.44%	1435932.68	2138085.52	0	0.00%
2018-07	-385041.36	-2.55%	0.00	385041.36	4	0.00%
2018-08	-137939.57	-0.94%	1571029.84	1708969.42	0	0.00%
2018-09	677147.92	4.65%	2010840.87	1333692.95	4	75.00%
2018-10	-87849.15	-0.58%	2152918.00	2240767.15	2	100.00%
2018-11	29284.66	0.19%	86863.24	57578.57	8	87.50%
2018-12	-1087071.59	-7.16%	1066811.63	2153883.22	0	0.00%
2019-01	577870.81	4.10%	1994450.59	1416579.78	4	0.00%
2019-02	2170957.10	14.79%	3484357.10	1313400.00	3	66.67%
2019-03	887769.60	5.27%	4053323.83	3165554.23	2	100.00%
2019-04	197839.21	1.12%	3503030.40	3305191.18	3	100.00%
2019-05	-1191849.83	-6.64%	1731831.80	2923681.63	14	57.14%

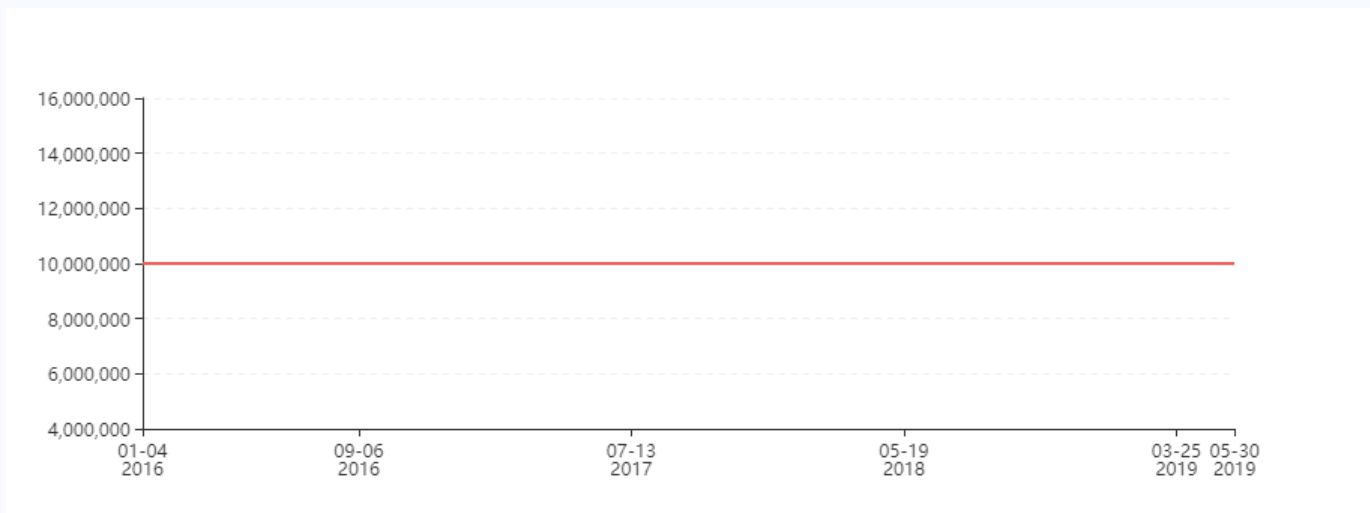


策略分析

多头权益曲线

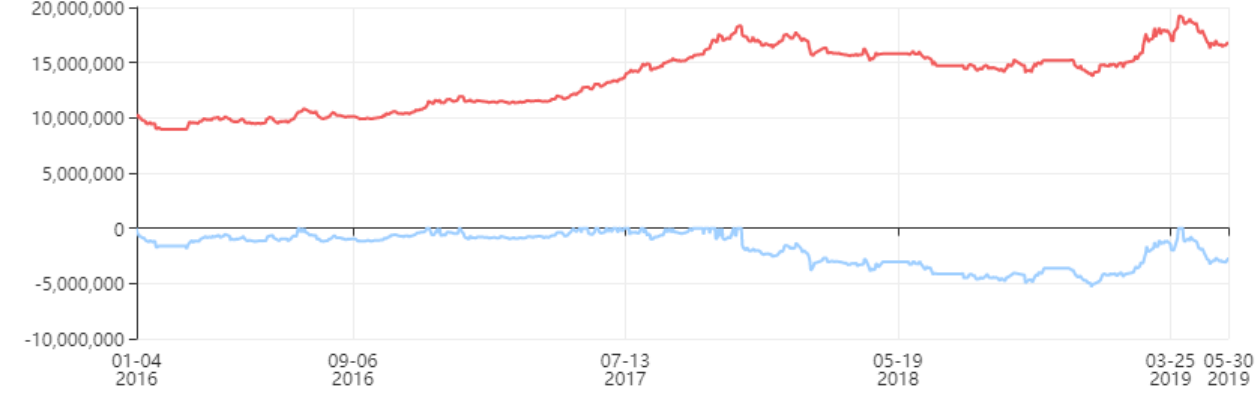


空头权益曲线



权益曲线及潜在亏损

-○- 权益曲线 -○- 潜在亏损



策略绩效概要

初始资金	10000000.00	算术年化收益率	20.51%
初始资金收益率	67.48%	几何年化收益率	16.97%
净利	6747991.03	最大回撤	4534122.94
毛利	13665353.87	最大回撤率	24.73%
毛损	-6917362.83	已付手续费	359567.97
盈利因子	1.98	已付滑价	0.00
多头净利	6747991.03	标的个数	34
空头净利	0.00		

绩效比率

夏普比率	Calmar比率	Sortino比率	净利/最大潜在亏损	手续费/净利
0.80	0.61	1.19	0.00	0.05

时间分析

策略天数	平均持仓时间	策略最大回撤期	策略最大不盈利天数
829	64.54	2017-11-21 ~ 2018-12-27	332.0

交易分析

连续交易分析

最大连续盈利天数	最大连续亏损天数	最大日连续盈利额	最大日连续亏损额
25	17	2356198.21	-1675547.59

总体交易分析

交易总数量	未平仓交易总数量	盈利交易次数	亏损交易次数	胜率	平均盈利额	平均亏损额	平均盈利/平均亏损	资金周转周期 (天)
-------	----------	--------	--------	----	-------	-------	-----------	------------

163

4

106

57

65.03%

128918.43

-121357.2
4

1.06

48.71