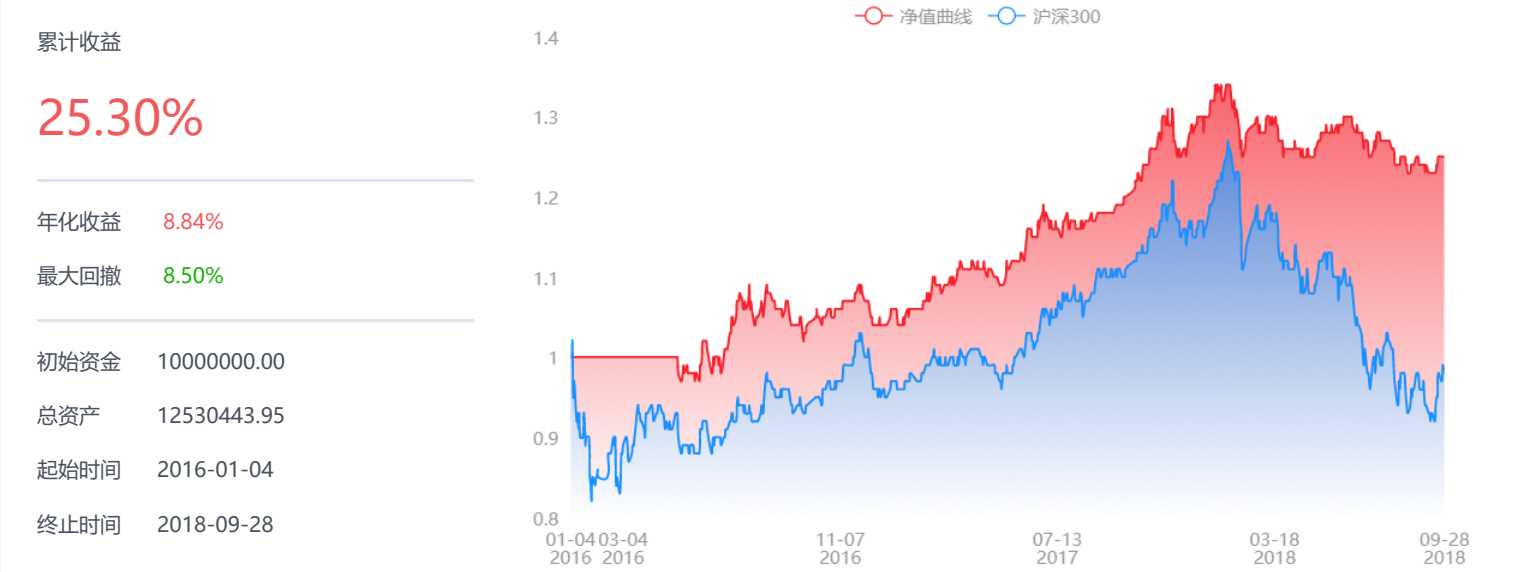


RF_line3-3

业绩走势



策略详情

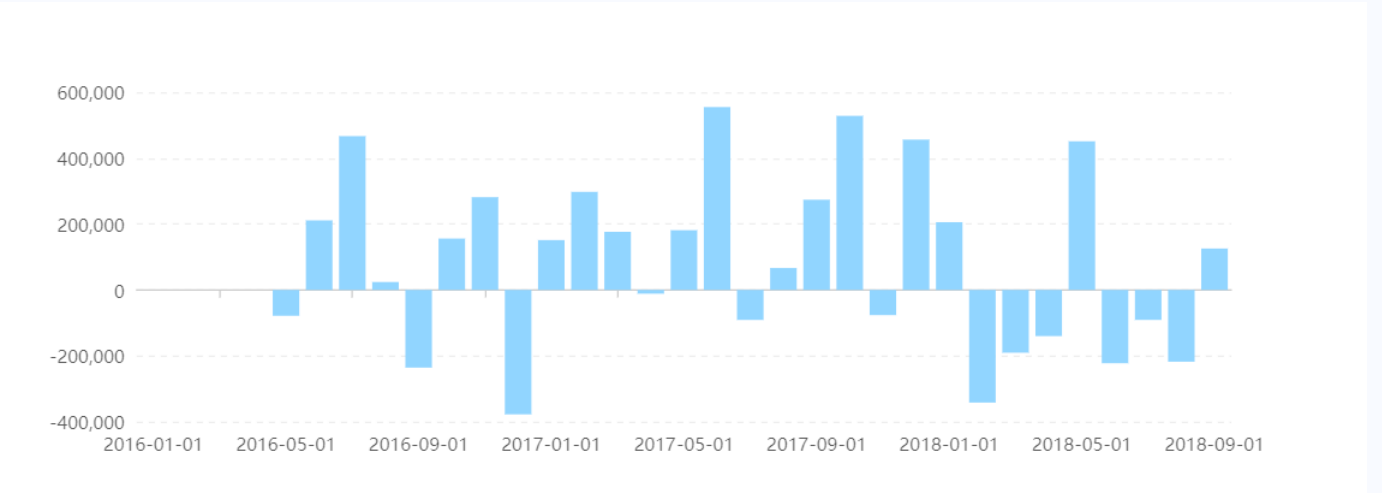
策略信息									
策略名称	年化收益率	基准收益率	阿尔法	贝塔	夏普比率	信息比率	最大回撤	换手率	回测时间
RF_line3-3	8.84%	-0.87%	0.08	0.32	0.71	0.81	8.50%	63.65%	2016-01-04~2018-09-28

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	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2016-02	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2016-03	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2016-04	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2016-05	-78513.05	-0.79%	891430.24	969943.29	0	0.00%
2016-06	210971.38	2.13%	1656681.81	1445710.43	12	0.00%
2016-07	466751.80	4.61%	1957562.03	1490810.23	15	0.00%
2016-08	23903.35	0.23%	1356548.32	1332644.97	17	0.00%
2016-09	-235935.44	-2.22%	921017.36	1156952.81	23	39.13%
2016-10	155846.25	1.50%	760588.12	604741.87	55	29.09%
2016-11	281372.23	2.67%	1078750.56	797378.33	37	43.24%

2016-12	-377803.47	-3.49%	938933.16	1316736.62	37	51.35%
2017-01	151166.52	1.45%	920295.96	769129.44	71	40.85%
2017-02	297633.14	2.81%	984293.49	686660.35	60	16.67%
2017-03	176230.65	1.62%	1181424.42	1005193.77	30	46.67%
2017-04	-11476.31	-0.10%	1129393.18	1140869.50	52	28.85%
2017-05	181126.83	1.64%	1114065.38	932938.55	70	35.71%
2017-06	554945.78	4.94%	1376528.09	821582.31	79	13.92%
2017-07	-91173.83	-0.77%	1059050.38	1150224.21	54	22.22%
2017-08	66320.11	0.57%	913531.81	847211.70	51	47.06%
2017-09	273649.41	2.32%	932744.86	659095.45	34	61.76%
2017-10	528345.82	4.39%	1199870.71	671524.89	66	53.03%
2017-11	-76558.32	-0.61%	1572297.62	1648855.95	73	21.92%
2017-12	456170.65	3.65%	1514577.00	1058406.35	77	23.38%
2018-01	205589.90	1.59%	1511547.92	1305958.02	78	28.21%
2018-02	-342070.85	-2.60%	814799.91	1156870.76	67	28.36%
2018-03	-190663.54	-1.49%	943273.48	1133937.01	81	37.04%
2018-04	-140229.76	-1.11%	522619.99	662849.75	98	56.12%
2018-05	451076.29	3.61%	917313.42	466237.13	85	29.41%
2018-06	-222640.40	-1.72%	625236.85	847877.25	78	17.95%
2018-07	-91122.60	-0.72%	618979.88	710102.48	83	9.64%
2018-08	-218011.42	-1.73%	540310.35	758321.77	72	33.33%
2018-09	125542.85	1.01%	473049.67	347506.81	318	33.02%

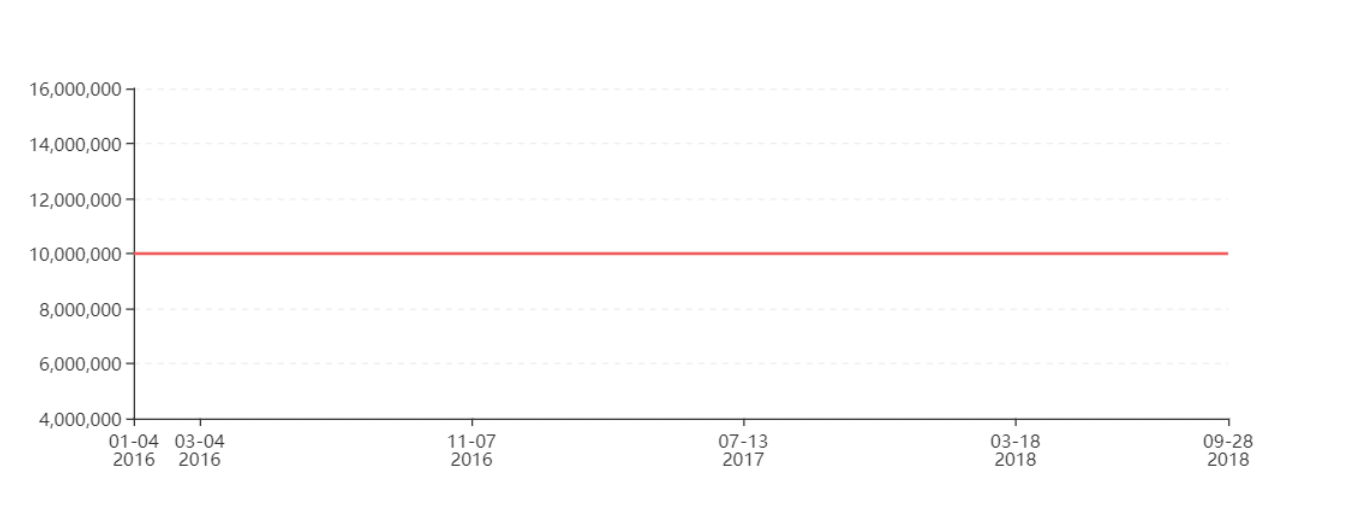
月盈利



多头权益曲线



空头权益曲线



权益曲线及潜在亏损



初始资金	10000000.00	算术年化收益率	9.50%
初始资金收益率	25.30%	几何年化收益率	8.84%
净利	2530443.95	最大回撤	1142537.36
毛利	3678351.04	最大回撤率	8.50%
毛损	-1147907.08	已付手续费	151639.86
盈利因子	3.20	已付滑价	0.00
多头净利	2530443.95	标的个数	256
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
0.71	0.80	1.01	0.00	0.06

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
671	424.16	2018-01-23 ~ 2018-09-12	-229.0

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
80	9	475033.41	-465205.49

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）
1873	251	593	1280	31.66%	6202.95	-896.80	6.92	395.94