

业绩走势



策略详情

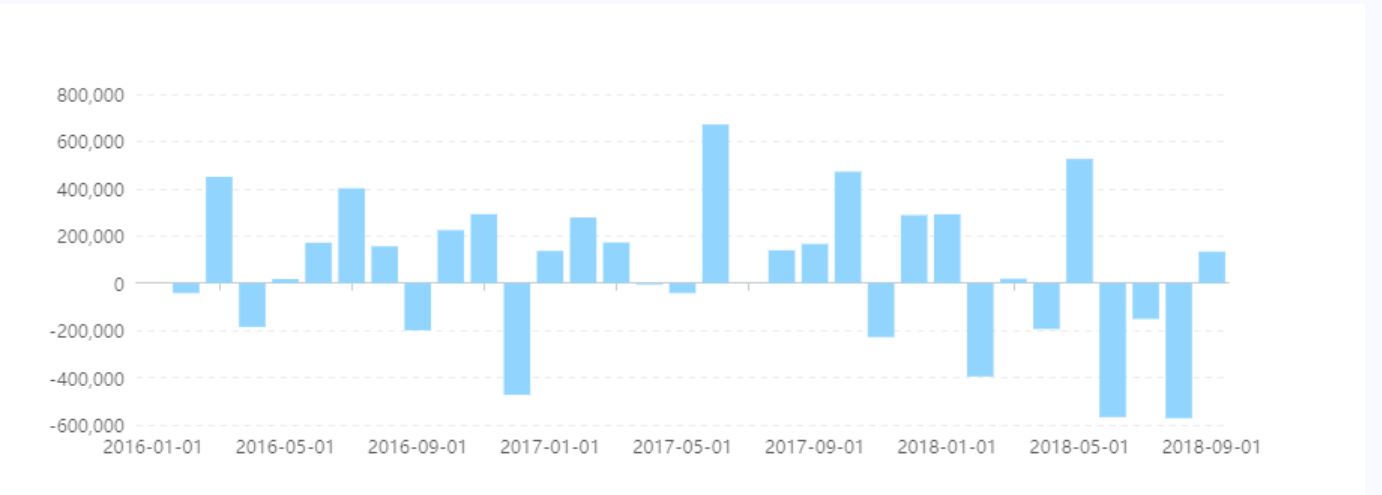
| 策略信息 | | | | | | | | | |
|------|-------|--------|------|------|------|------|--------|--------|-----------------------|
| 策略名称 | 年化收益率 | 基准收益率 | 阿尔法 | 贝塔 | 夏普比率 | 信息比率 | 最大回撤 | 换手率 | 回测时间 |
| svm | 6.90% | -0.87% | 0.07 | 0.50 | 0.41 | 0.83 | 14.57% | 39.48% | 2016-01-04~2018-09-28 |

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 | -42541.39 | -0.43% | 505758.01 | 548299.40 | 0 | 0.00% |
| 2016-03 | 449833.42 | 4.52% | 1164822.43 | 714989.01 | 7 | 57.14% |
| 2016-04 | -185451.54 | -1.78% | 842225.56 | 1027677.10 | 20 | 80.00% |
| 2016-05 | 17307.45 | 0.17% | 1288206.13 | 1270898.68 | 27 | 44.44% |
| 2016-06 | 170958.88 | 1.67% | 1310453.76 | 1139494.88 | 23 | 52.17% |
| 2016-07 | 401111.48 | 3.85% | 1703217.27 | 1302105.79 | 26 | 26.92% |
| 2016-08 | 155873.86 | 1.44% | 1389848.28 | 1233974.42 | 32 | 31.25% |
| 2016-09 | -199532.37 | -1.82% | 927373.70 | 1126906.07 | 42 | 71.43% |
| 2016-10 | 224055.61 | 2.08% | 893457.15 | 669401.54 | 46 | 45.65% |
| 2016-11 | 292213.06 | 2.66% | 1233089.81 | 940876.75 | 47 | 72.34% |

| | | | | | | |
|---------|------------|--------|------------|------------|-----|--------|
| 2016-12 | -473337.51 | -4.19% | 1012136.67 | 1485474.18 | 56 | 71.43% |
| 2017-01 | 136448.97 | 1.26% | 918433.62 | 781984.66 | 44 | 59.09% |
| 2017-02 | 277846.99 | 2.54% | 959944.51 | 682097.52 | 47 | 34.04% |
| 2017-03 | 171973.35 | 1.53% | 1187735.04 | 1015761.69 | 48 | 77.08% |
| 2017-04 | -5859.10 | -0.05% | 1174278.22 | 1180137.31 | 47 | 44.68% |
| 2017-05 | -42282.50 | -0.37% | 1140119.33 | 1182401.83 | 49 | 38.78% |
| 2017-06 | 671787.03 | 5.92% | 1597021.39 | 925234.36 | 50 | 26.00% |
| 2017-07 | -1024.37 | -0.01% | 1329076.50 | 1330100.88 | 40 | 47.50% |
| 2017-08 | 139100.91 | 1.16% | 1315886.23 | 1176785.32 | 49 | 71.43% |
| 2017-09 | 165786.75 | 1.36% | 1167381.34 | 1001594.59 | 52 | 63.46% |
| 2017-10 | 472123.30 | 3.83% | 1421137.29 | 949013.99 | 50 | 50.00% |
| 2017-11 | -228626.47 | -1.79% | 1749450.33 | 1978076.80 | 47 | 34.04% |
| 2017-12 | 287814.35 | 2.29% | 1533637.29 | 1245822.94 | 53 | 43.40% |
| 2018-01 | 291467.97 | 2.27% | 1847439.68 | 1555971.71 | 48 | 31.25% |
| 2018-02 | -395428.73 | -3.01% | 1180637.98 | 1576066.70 | 50 | 42.00% |
| 2018-03 | 18602.60 | 0.15% | 1552454.97 | 1533852.37 | 49 | 32.65% |
| 2018-04 | -194559.45 | -1.52% | 1140569.75 | 1335129.20 | 46 | 65.22% |
| 2018-05 | 525564.23 | 4.18% | 1731743.64 | 1206179.41 | 48 | 41.67% |
| 2018-06 | -567172.61 | -4.33% | 1316883.16 | 1884055.77 | 44 | 25.00% |
| 2018-07 | -151657.82 | -1.21% | 1355400.22 | 1507058.03 | 48 | 20.83% |
| 2018-08 | -572020.73 | -4.62% | 1276476.09 | 1848496.83 | 45 | 44.44% |
| 2018-09 | 133134.99 | 1.13% | 1044244.50 | 911109.51 | 297 | 41.41% |

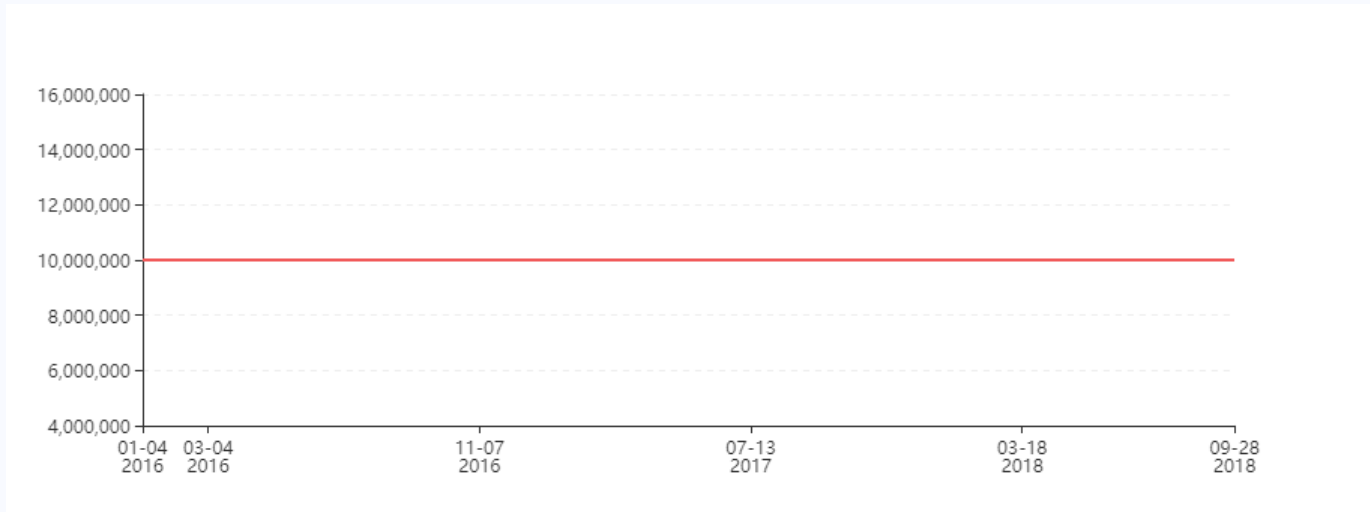
月盈利



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 | 7.30% |
| 初始资金收益率 | 19.44% | 几何年化收益率 | 6.90% |
| 净利 | 1943510.62 | 最大回撤 | 1954888.89 |
| 毛利 | 3149757.28 | 最大回撤率 | 14.57% |
| 毛损 | -1206246.66 | 已付手续费 | 90894.46 |
| 盈利因子 | 2.61 | 已付滑价 | 0.00 |
| 多头净利 | 1943510.62 | 标的个数 | 257 |
| 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 |
| 0.41 | 0.34 | 0.58 | 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 |
| 671 | 487.30 | 2018-01-26 ~ 2018-09-17 | -212.0 |

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 |
| 9 | 21 | 643857.15 | -631677.55 |

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） |
| 1577 | 257 | 735 | 842 | 46.61% | 4285.38 | -1432.60 | 2.99 | 638.25 |