

业绩走势

累计收益

21.48%

年化收益 7.58%

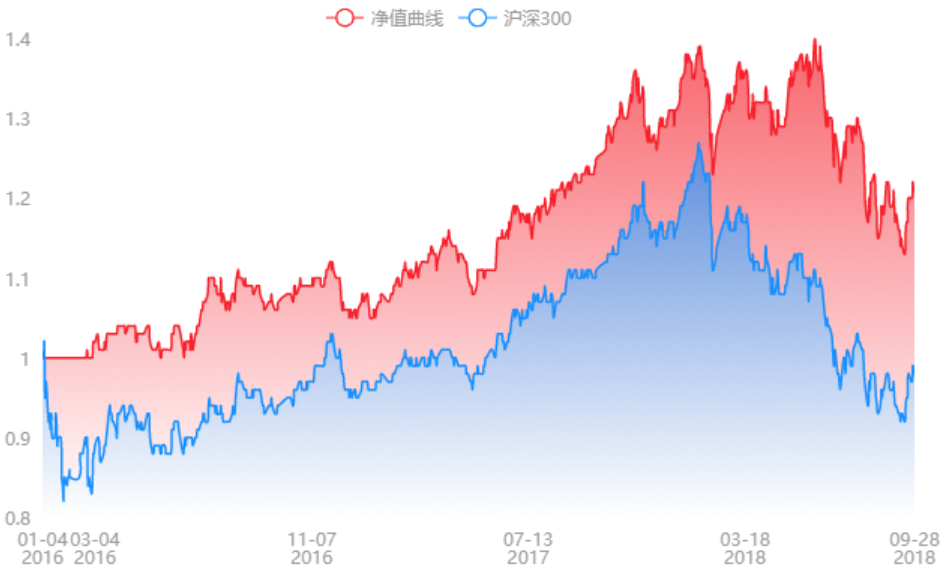
最大回撤 18.96%

初始资金 10000000.00

总资产 12148455.51

起始时间 2016-01-04

终止时间 2018-09-28



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	7.58%	-0.87%	0.08	0.58	0.38	0.83	18.96%	38.61%	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	8985.10	0.09%	89949.41	80964.31	0	0.00%
2016-03	379342.32	3.79%	1036711.11	657368.80	0	0.00%
2016-04	-80798.61	-0.78%	504007.40	584806.00	13	61.54%
2016-05	-44592.83	-0.43%	817727.02	862319.85	0	0.00%
2016-06	130399.90	1.27%	1294347.24	1163947.34	0	0.00%
2016-07	370613.36	3.57%	1561377.97	1190764.61	0	0.00%
2016-08	152259.38	1.41%	1252452.54	1100193.16	0	0.00%
2016-09	-236256.85	-2.16%	758375.37	994632.22	25	88.00%
2016-10	192166.09	1.80%	873222.54	681056.45	0	0.00%
2016-11	267275.93	2.46%	1237502.51	970226.58	28	67.86%

2016-12	-577434.91	-5.18%	996202.06	1573636.97	30	93.33%
2017-01	194400.36	1.84%	1084368.34	889967.98	0	0.00%
2017-02	294512.00	2.74%	1067879.66	773367.66	0	0.00%
2017-03	164241.33	1.49%	1336689.23	1172447.90	20	85.00%
2017-04	43530.92	0.39%	1420486.05	1376955.12	0	0.00%
2017-05	-178491.19	-1.59%	1278563.87	1457055.06	0	0.00%
2017-06	791364.52	7.14%	1894173.79	1102809.28	0	0.00%
2017-07	69865.86	0.59%	1605191.35	1535325.49	29	65.52%
2017-08	191413.34	1.60%	1667921.58	1476508.24	2	100.00%
2017-09	337304.44	2.78%	1574956.34	1237651.91	33	66.67%
2017-10	559803.78	4.49%	1959549.51	1399745.74	0	0.00%
2017-11	-341845.30	-2.62%	2316865.50	2658710.80	0	0.00%
2017-12	450093.53	3.55%	2214698.53	1764605.00	0	0.00%
2018-01	475133.77	3.62%	2566358.85	2091225.08	0	0.00%
2018-02	-467263.00	-3.43%	1785143.62	2252406.62	0	0.00%
2018-03	89861.73	0.68%	2426416.87	2336555.14	0	0.00%
2018-04	-355390.96	-2.69%	1742439.86	2097830.81	0	0.00%
2018-05	856534.89	6.65%	2705288.52	1848753.64	0	0.00%
2018-06	-908302.25	-6.61%	2072191.53	2980493.78	0	0.00%
2018-07	-146721.23	-1.14%	2241685.88	2388407.11	0	0.00%
2018-08	-780162.34	-6.15%	2173214.83	2953377.17	0	0.00%
2018-09	246612.45	2.07%	1849778.45	1603166.00	173	42.20%

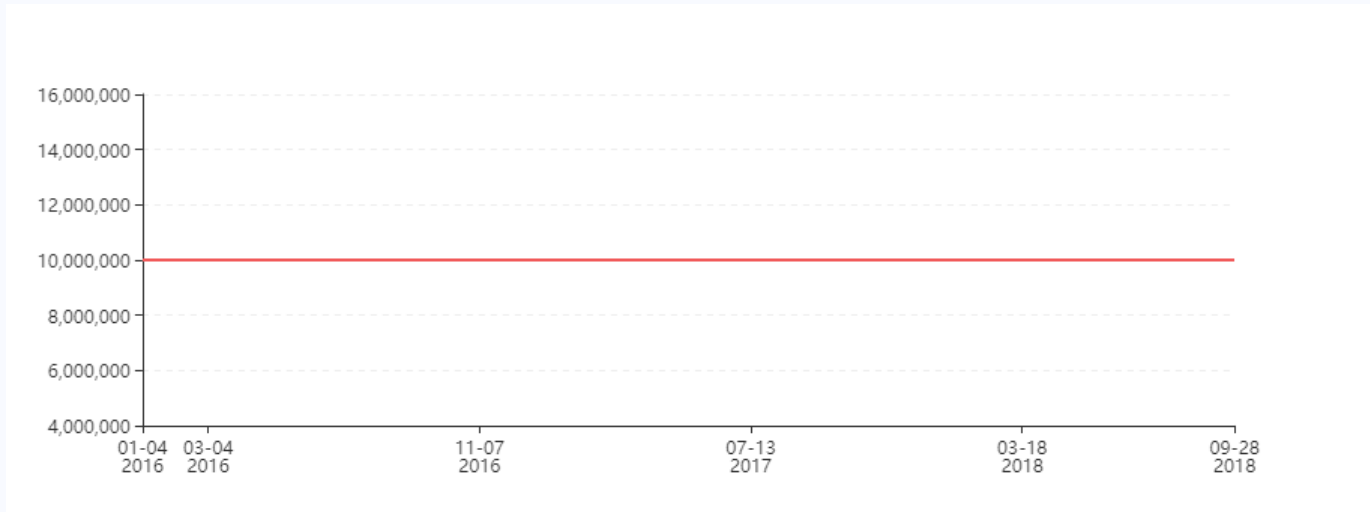
月盈利



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	8.07%
初始资金收益率	21.48%	几何年化收益率	7.58%
净利	2148455.51	最大回撤	2645646.63
毛利	3837890.56	最大回撤率	18.96%
毛损	-1689435.05	已付手续费	89220.49
盈利因子	2.27	已付滑价	0.00
多头净利	2148455.51	标的个数	173
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
0.38	0.29	0.54	0.00	0.04

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	535.23	2018-06-06 ~ 2018-09-17	-1.0

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	889962.25	-1386998.33

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）
353	173	210	143	59.49%	18275.67	-11814.23	1.55	652.71