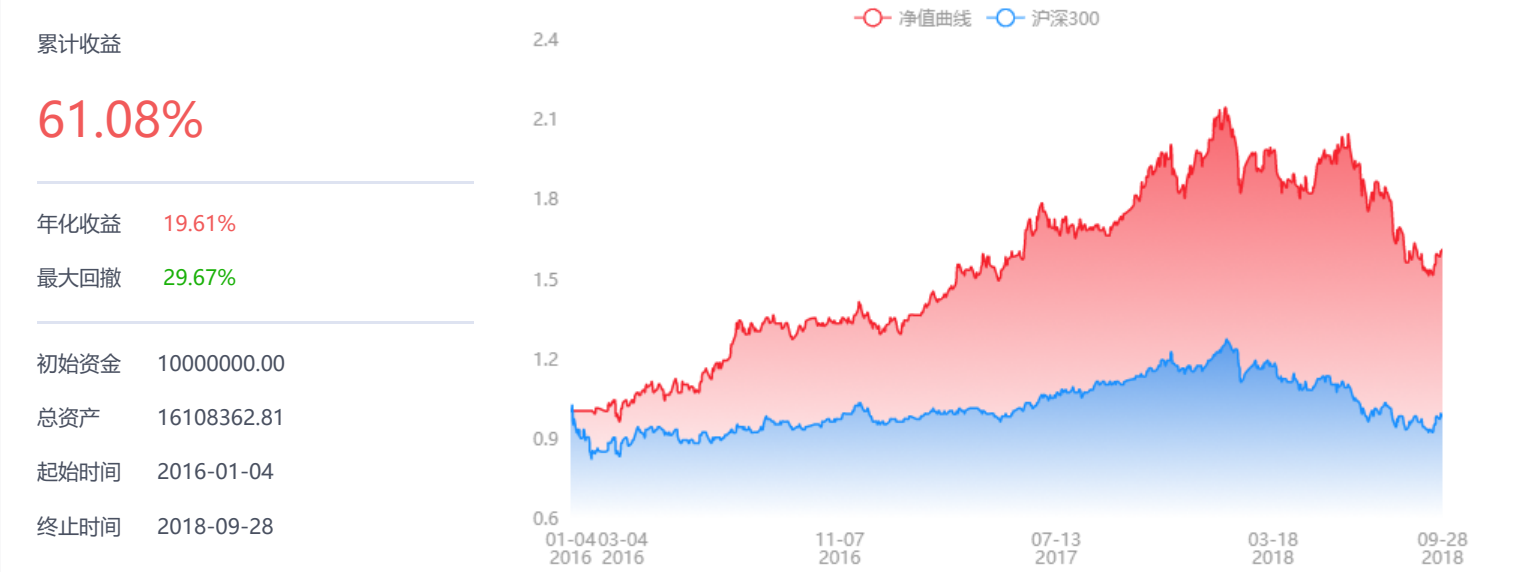


random_forest_reg

业绩走势



策略详情

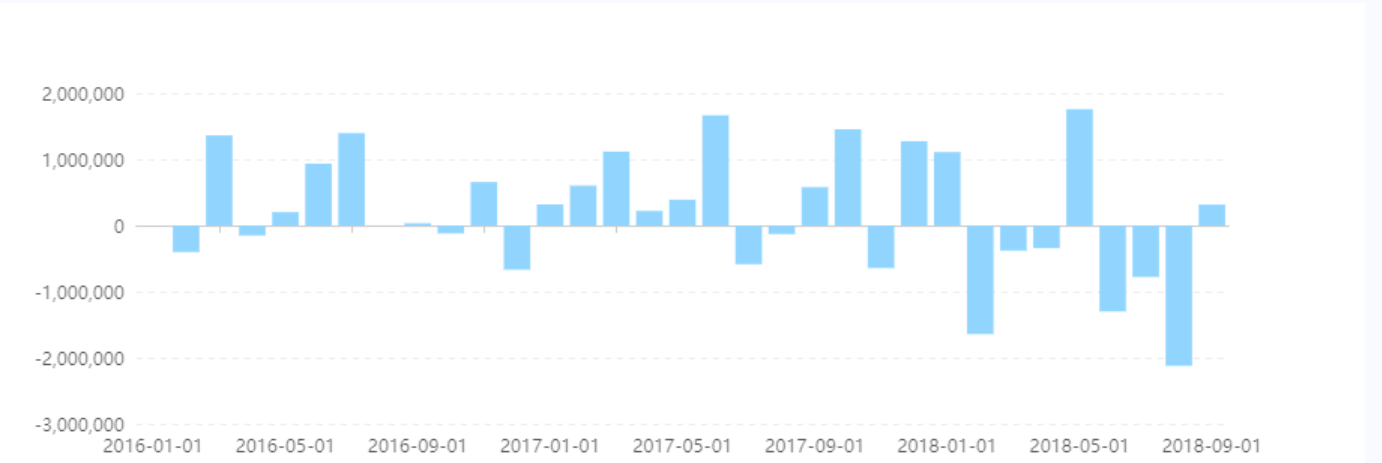
策略信息									
策略名称	年化收益率	基准收益率	阿尔法	贝塔	夏普比率	信息比率	最大回撤	换手率	回测时间
random_forest_reg	19.61%	-0.87%	0.21	0.77	0.84	1.39	29.67%	43.06%	2016-01-04~2018-09-28

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	-401782.46	-4.02%	1015532.15	1417314.61	0	0.00%
2016-03	1361733.07	14.19%	2250441.94	888708.87	0	0.00%
2016-04	-152327.62	-1.39%	1065082.79	1217410.41	1	100.00%
2016-05	200993.85	1.86%	1438468.58	1237474.73	0	0.00%
2016-06	933319.12	8.48%	2205080.49	1271761.38	1	0.00%
2016-07	1395825.04	11.69%	2841638.53	1445813.49	1	0.00%
2016-08	2637.94	0.02%	1504314.98	1501677.05	3	33.33%
2016-09	32552.31	0.24%	1322536.67	1289984.37	5	100.00%
2016-10	-120478.70	-0.90%	869721.32	990200.02	3	33.33%
2016-11	656152.81	4.95%	1823367.30	1167214.50	5	60.00%

2016-12	-668456.63	-4.81%	1284020.12	1952476.75	10	70.00%
2017-01	318185.88	2.40%	1422438.78	1104252.90	7	14.29%
2017-02	601590.61	4.44%	1607596.12	1006005.50	9	11.11%
2017-03	1116348.04	7.88%	2501656.97	1385308.93	12	50.00%
2017-04	219337.40	1.44%	2224666.26	2005328.86	13	30.77%
2017-05	388656.31	2.51%	2144364.40	1755708.08	12	16.67%
2017-06	1663992.25	10.48%	3580107.79	1916115.54	19	42.11%
2017-07	-586329.09	-3.34%	2165190.03	2751519.12	14	35.71%
2017-08	-129895.38	-0.77%	2044037.16	2173932.55	17	64.71%
2017-09	579156.35	3.44%	2121466.43	1542310.08	23	52.17%
2017-10	1455061.26	8.36%	3041084.75	1586023.48	28	53.57%
2017-11	-644051.82	-3.41%	3193626.66	3837678.47	24	16.67%
2017-12	1274678.23	7.00%	3471693.93	2197015.70	21	23.81%
2018-01	1108711.10	5.69%	4409447.78	3300736.68	27	7.41%
2018-02	-1643493.24	-7.98%	2323362.35	3966855.59	26	15.38%
2018-03	-380465.27	-2.01%	3070698.13	3451163.39	24	25.00%
2018-04	-343059.26	-1.85%	2280951.37	2624010.63	38	55.26%
2018-05	1757033.25	9.63%	4547176.96	2790143.71	21	23.81%
2018-06	-1300581.65	-6.50%	2778916.90	4079498.55	28	21.43%
2018-07	-779956.68	-4.17%	2771709.98	3551666.67	26	3.85%
2018-08	-2122009.15	-11.84%	2682928.26	4804937.41	32	40.63%
2018-09	315284.94	2.00%	1986980.54	1671695.61	189	33.86%

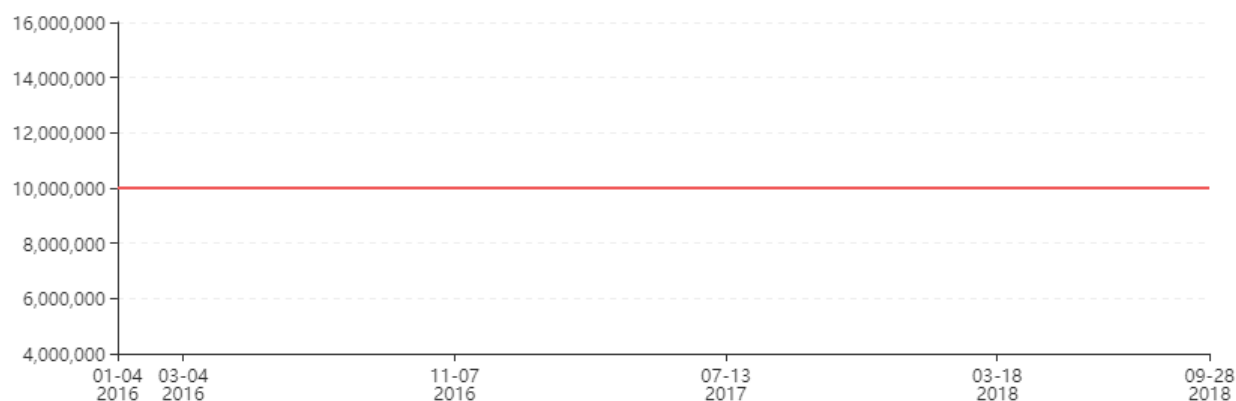
月盈利



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	22.94%
初始资金收益率	61.08%	几何年化收益率	19.61%
净利	6108362.81	最大回撤	6361725.74
毛利	6819787.81	最大回撤率	29.67%
毛损	-711425.00	已付手续费	131158.01
盈利因子	9.59	已付滑价	0.00
多头净利	6108362.81	标的个数	164
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
0.84	0.59	1.26	0.00	0.02

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	351.46	2018-01-23 ~ 2018-09-17	-13.0

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
7	21	1560671.85	-2122564.64

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)
639	165	214	425	33.49%	31868.17	-1673.94	19.04	585.19