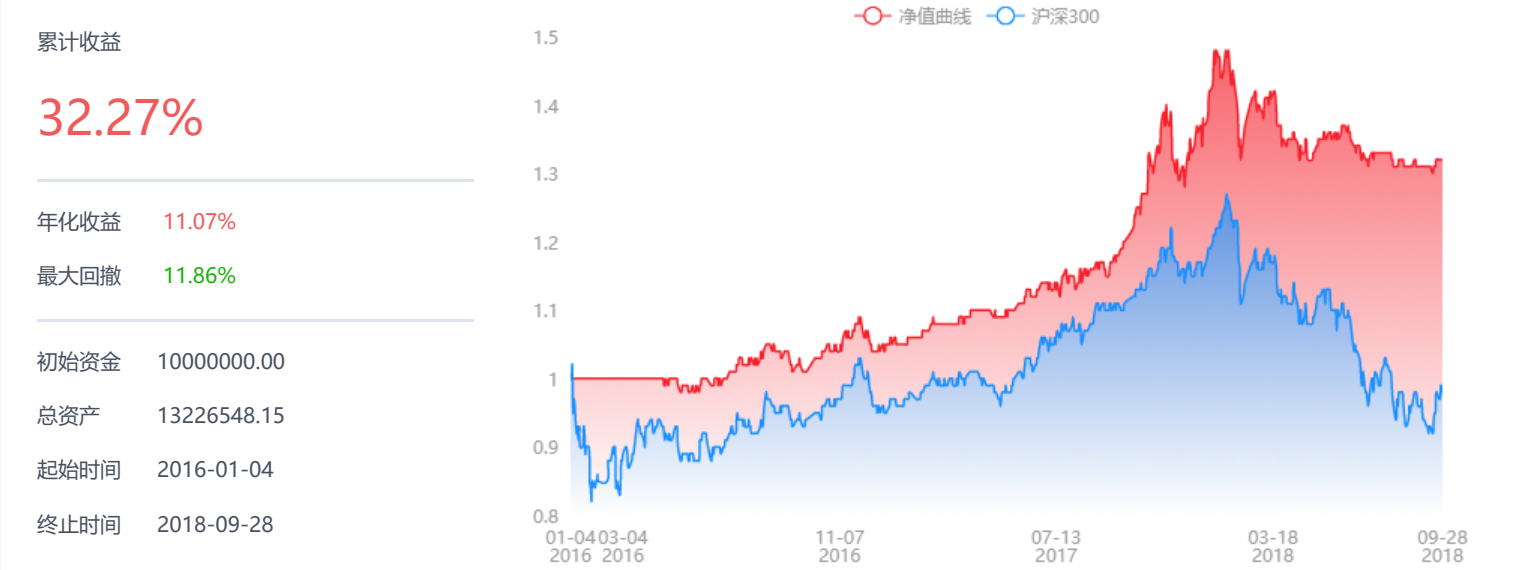


# Istm25-2

## 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
Istm25-2	11.07%	-0.87%	0.10	0.32	0.85	0.93	11.86%	89.83%	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	-36919.58	-0.37%	310090.42	347010.00	0	0.00%
2016-05	-23796.08	-0.24%	665429.86	689225.94	20	15.00%
2016-06	65072.27	0.65%	533518.49	468446.22	27	25.93%
2016-07	275156.85	2.75%	711544.47	436387.62	4	25.00%
2016-08	95288.51	0.93%	741662.03	646373.52	3	0.00%
2016-09	-232746.71	-2.24%	676242.10	908988.81	26	53.85%
2016-10	280857.18	2.77%	696537.07	415679.90	32	21.88%
2016-11	399421.92	3.83%	959408.86	559986.93	14	71.43%

2016-12	-357774.04	-3.31%	726853.57	1084627.62	7	71.43%
2017-01	155340.40	1.48%	479141.43	323801.04	32	46.88%
2017-02	187224.41	1.76%	593936.33	406711.92	21	38.10%
2017-03	49647.44	0.46%	630558.96	580911.52	8	75.00%
2017-04	99117.89	0.91%	691635.76	592517.87	6	83.33%
2017-05	110741.93	1.01%	640651.13	529909.20	11	63.64%
2017-06	339852.87	3.07%	836080.13	496227.26	5	20.00%
2017-07	122643.82	1.08%	1342735.38	1220091.56	3	33.33%
2017-08	104442.33	0.91%	1150677.59	1046235.26	9	55.56%
2017-09	364307.95	3.13%	1211333.77	847025.82	7	57.14%
2017-10	1061621.54	8.85%	2100581.76	1038960.22	15	60.00%
2017-11	-136594.55	-1.05%	2478927.81	2615522.36	5	60.00%
2017-12	801988.81	6.21%	2451495.15	1649506.34	4	0.00%
2018-01	777289.02	5.66%	2849514.14	2072225.12	13	38.46%
2018-02	-625293.98	-4.31%	1473471.33	2098765.31	16	56.25%
2018-03	-384394.47	-2.77%	1525478.66	1909873.13	14	64.29%
2018-04	-280536.65	-2.08%	966376.22	1246912.87	19	78.95%
2018-05	416392.67	3.15%	1147472.24	731079.57	15	66.67%
2018-06	-331848.95	-2.43%	768593.08	1100442.04	16	56.25%
2018-07	-33852.65	-0.25%	532792.30	566644.95	19	31.58%
2018-08	-143942.58	-1.09%	398409.73	542352.31	14	28.57%
2018-09	107840.59	0.82%	360993.95	253153.36	39	25.64%

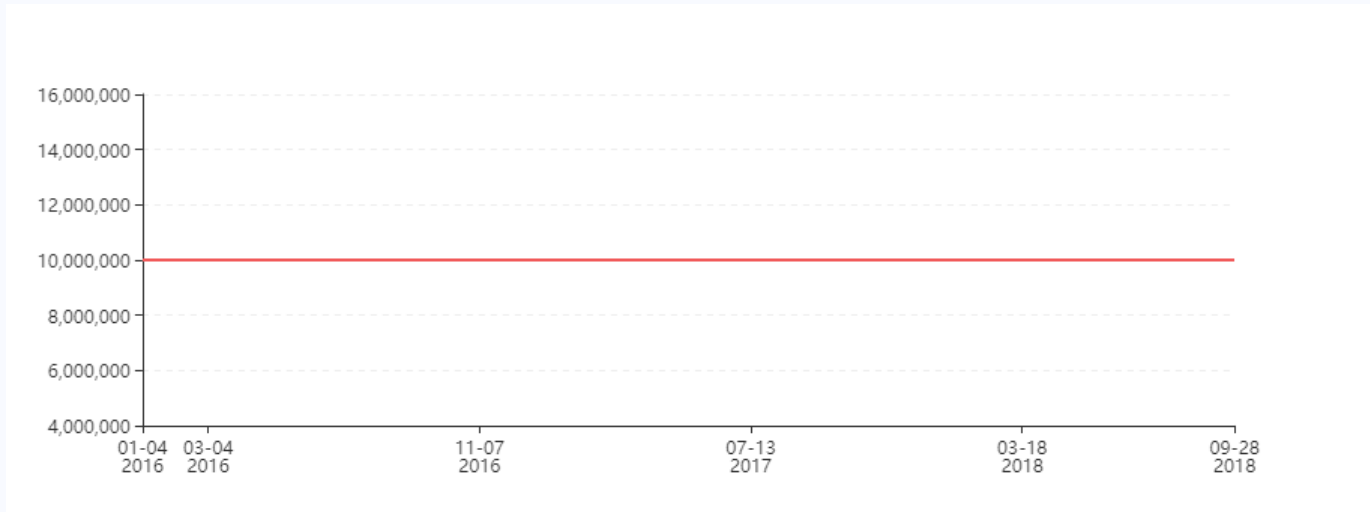
月盈利



多头权益曲线



空头权益曲线



权益曲线及潜在亏损



策略绩效概要

初始资金	10000000.00	算术年化收益率	12.12%
初始资金收益率	32.27%	几何年化收益率	11.07%
净利	3226548.15	最大回撤	1755865.84
毛利	4379115.82	最大回撤率	11.86%
毛损	-1152567.67	已付手续费	209360.43
盈利因子	3.80	已付滑价	0.00
多头净利	3226548.15	标的个数	235
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
0.85	0.77	1.25	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	192.22	2018-01-26 ~ 2018-09-17	-16.0

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
13	60	1027336.03	-1093652.94

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）
424	33	189	235	44.58%	23169.92	-4904.54	4.72	280.54