

# same-weight-model

## 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
same-weight-model	11.96%	-0.87%	0.11	0.43	0.92	1.17	13.70%	19.33%	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	-20151.44	-0.20%	408044.79	428196.23	0	0.00%
2016-03	450936.88	4.52%	837601.52	386664.64	0	0.00%
2016-04	-83030.45	-0.80%	464486.58	547517.04	0	0.00%
2016-05	68734.94	0.66%	625169.21	556434.27	0	0.00%
2016-06	162314.35	1.56%	718847.35	556533.00	0	0.00%
2016-07	238903.24	2.26%	893194.38	654291.14	0	0.00%
2016-08	55261.30	0.51%	665966.66	610705.36	0	0.00%
2016-09	-154782.77	-1.42%	400506.31	555289.07	0	0.00%
2016-10	171192.93	1.60%	489594.72	318401.79	0	0.00%
2016-11	220467.82	2.02%	727500.75	507032.94	0	0.00%

2016-12	-272019.90	-2.45%	615283.01	887302.92	0	0.00%
2017-01	97043.24	0.90%	546351.56	449308.33	0	0.00%
2017-02	231967.53	2.12%	620394.09	388426.56	0	0.00%
2017-03	262158.37	2.35%	844428.52	582270.15	0	0.00%
2017-04	52221.42	0.46%	864850.98	812629.57	0	0.00%
2017-05	244717.43	2.13%	927734.88	683017.45	0	0.00%
2017-06	498223.18	4.25%	1271284.97	773061.79	0	0.00%
2017-07	-60298.95	-0.49%	984317.46	1044616.41	1	0.00%
2017-08	133777.92	1.10%	1039614.44	905836.52	0	0.00%
2017-09	359795.37	2.93%	1085217.90	725422.53	0	0.00%
2017-10	665663.19	5.26%	1502240.12	836576.93	0	0.00%
2017-11	-73116.89	-0.55%	1900411.24	1973528.12	0	0.00%
2017-12	489706.46	3.70%	1713168.60	1223462.14	0	0.00%
2018-01	548838.95	3.99%	2119307.78	1570468.83	1	0.00%
2018-02	-457919.08	-3.20%	1186115.54	1644034.62	1	0.00%
2018-03	-182688.96	-1.32%	1593093.17	1775782.13	0	0.00%
2018-04	-256357.51	-1.88%	1215720.96	1472078.47	0	0.00%
2018-05	979835.80	7.32%	2185624.54	1205788.74	0	0.00%
2018-06	-553701.70	-3.85%	1578371.25	2132072.95	0	0.00%
2018-07	-111294.91	-0.81%	1648570.77	1759865.68	0	0.00%
2018-08	-624218.70	-4.55%	1758264.64	2382483.34	0	0.00%
2018-09	426157.68	3.26%	1548073.36	1121915.68	104	59.62%

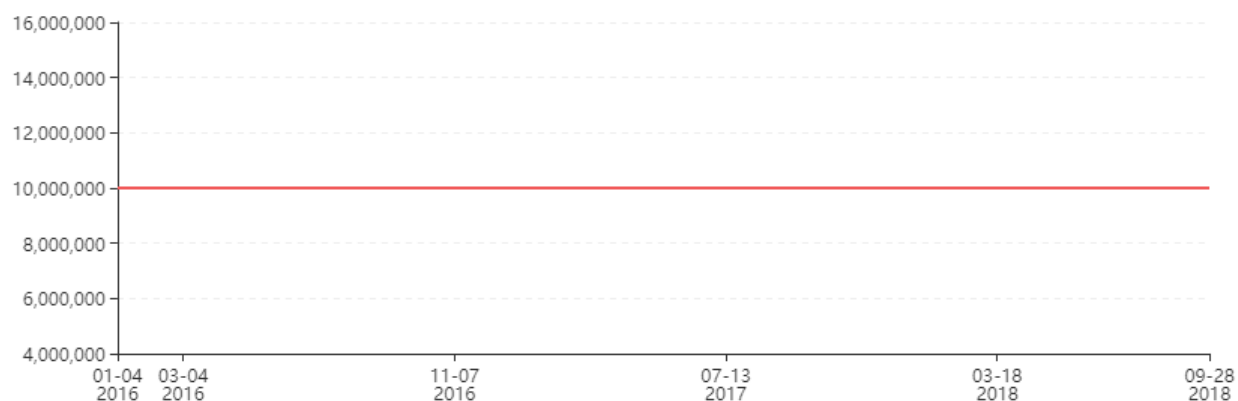
月盈利



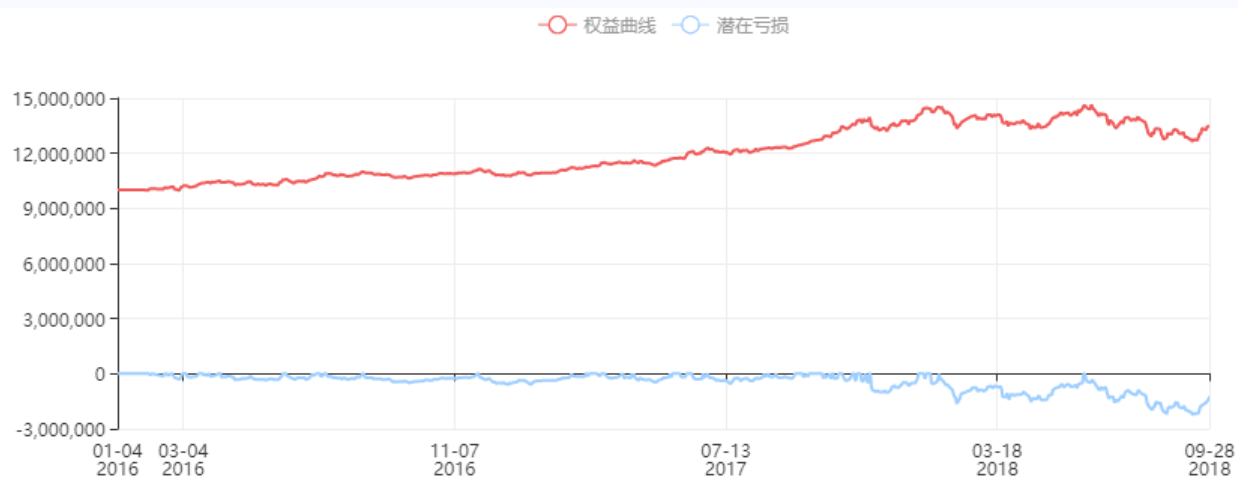
多头权益曲线



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	13.18%
初始资金收益率	35.08%	几何年化收益率	11.96%
净利	3508336.74	最大回撤	2007460.24
毛利	3987149.07	最大回撤率	13.70%
毛损	-478812.33	已付手续费	56924.96
盈利因子	8.33	已付滑价	0.00
多头净利	3508336.74	标的个数	101
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
0.92	0.73	1.37	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	751.56	2018-06-12 ~ 2018-09-12	-5.0

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	731655.43	-926564.68

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)
107	103	63	44	58.88%	63288.08	-10882.10	5.82	1303.63