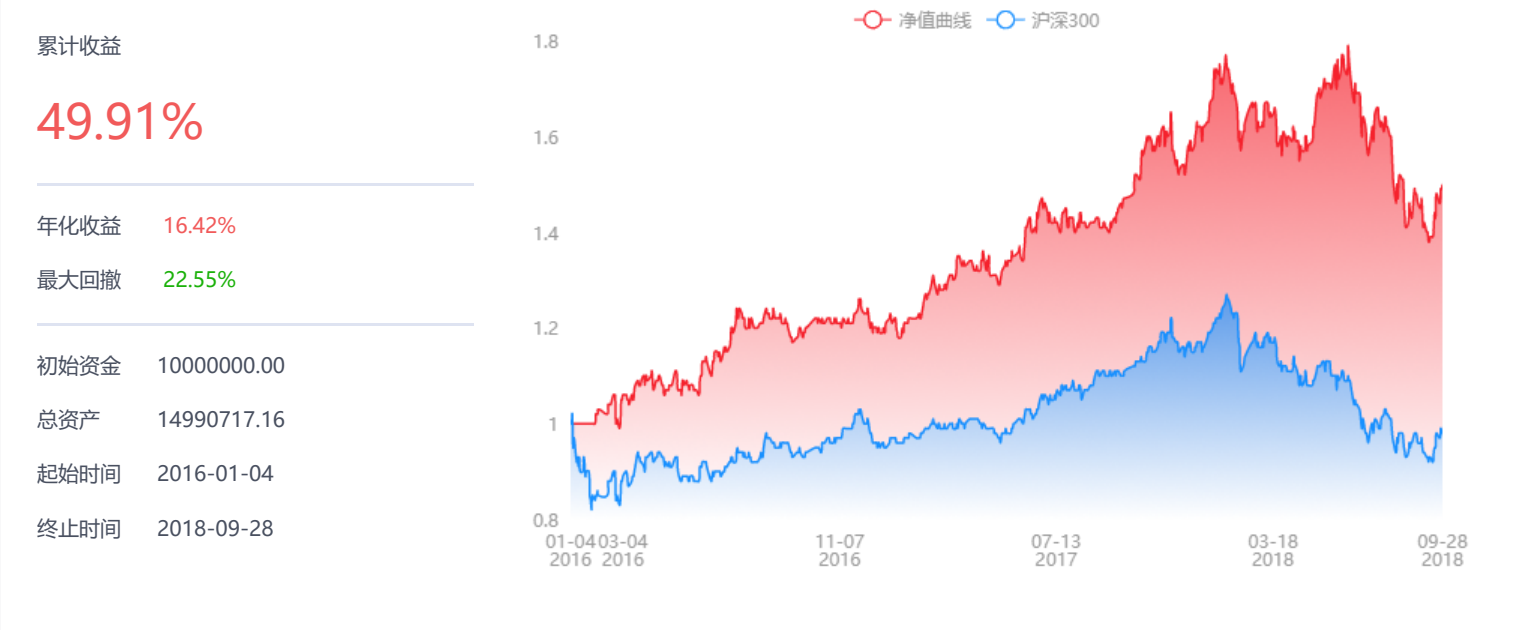


multi_factor_lr

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
multi_factor_lr	16.42%	-0.87%	0.17	0.71	0.79	1.38	22.55%	46.63%	2016-01-04~2018-09-28

周期分析

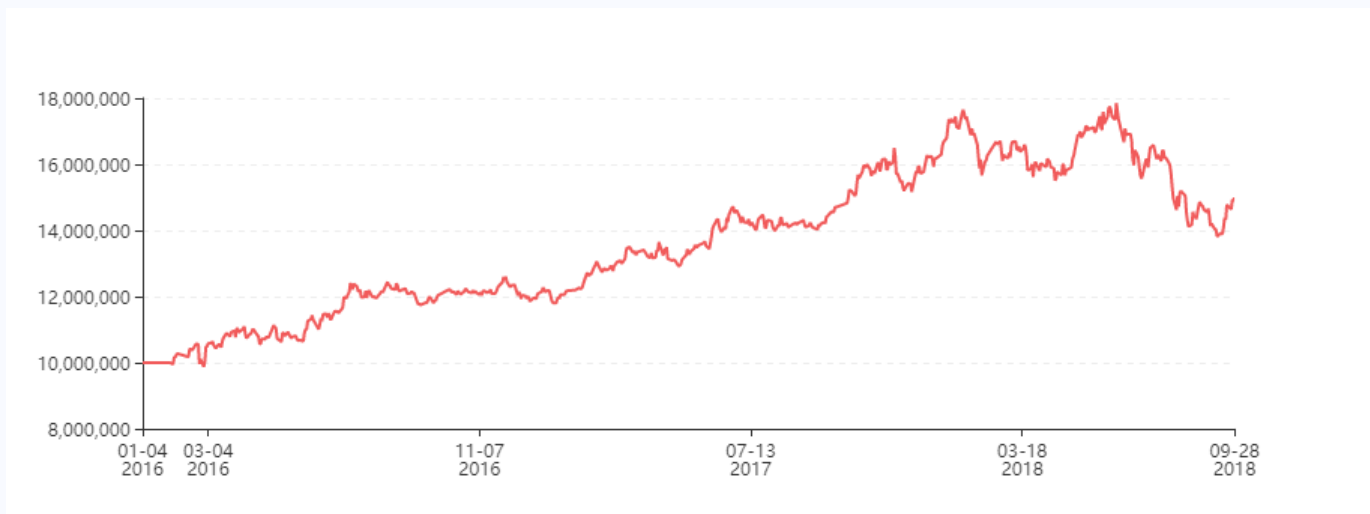
月周期分析						
月份	净利	净利率	毛利	毛损	交易次数	胜率
2016-01	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2016-02	-123808.69	-1.24%	1245676.78	1369485.47	0	0.00%
2016-03	1145700.92	11.60%	2372071.77	1226370.85	1	0.00%
2016-04	-211353.53	-1.92%	1114125.98	1325479.51	3	100.00%
2016-05	100642.46	0.93%	1368514.21	1267871.75	4	100.00%
2016-06	652407.04	5.98%	1840628.96	1188221.92	2	50.00%
2016-07	618160.75	5.35%	2011684.42	1393523.67	1	0.00%
2016-08	74256.97	0.61%	1295013.58	1220756.61	4	0.00%
2016-09	-219283.97	-1.79%	911710.93	1130994.90	8	87.50%
2016-10	71176.23	0.59%	756907.97	685731.73	7	28.57%
2016-11	401845.04	3.32%	1337091.87	935246.82	11	72.73%

2016-12	-430974.04	-3.45%	1129922.89	1560896.94	14	85.71%
2017-01	95001.75	0.79%	1016542.93	921541.18	2	0.00%
2017-02	610367.20	5.01%	1446105.86	835738.66	7	57.14%
2017-03	556903.00	4.36%	1786600.36	1229697.36	22	54.55%
2017-04	-195366.89	-1.46%	1632353.24	1827720.13	11	36.36%
2017-05	475932.39	3.62%	1615685.87	1139753.48	16	31.25%
2017-06	988465.87	7.26%	2477573.01	1489107.14	14	7.14%
2017-07	-320391.44	-2.19%	1672570.37	1992961.82	24	50.00%
2017-08	-104674.70	-0.73%	1530004.48	1634679.17	30	73.33%
2017-09	516679.80	3.64%	1863930.48	1347250.68	42	61.90%
2017-10	953314.69	6.48%	2482179.98	1528865.30	30	53.33%
2017-11	-453734.31	-2.90%	2708922.97	3162657.28	17	23.53%
2017-12	969692.31	6.38%	2831038.38	1861346.07	29	37.93%
2018-01	907240.02	5.61%	3642752.98	2735512.97	28	10.71%
2018-02	-971486.48	-5.69%	2016491.05	2987977.53	24	20.83%
2018-03	-31203.05	-0.19%	2843773.71	2874976.76	30	26.67%
2018-04	-263966.68	-1.64%	2137067.92	2401034.60	45	57.78%
2018-05	1777741.97	11.24%	3876802.83	2099060.87	29	20.69%
2018-06	-1160576.41	-6.60%	2595597.43	3756173.84	27	29.63%
2018-07	-461166.98	-2.81%	2611133.85	3072300.83	33	12.12%
2018-08	-1337943.66	-8.38%	2700245.07	4038188.72	30	33.33%
2018-09	361119.60	2.47%	2136404.04	1775284.44	241	37.76%

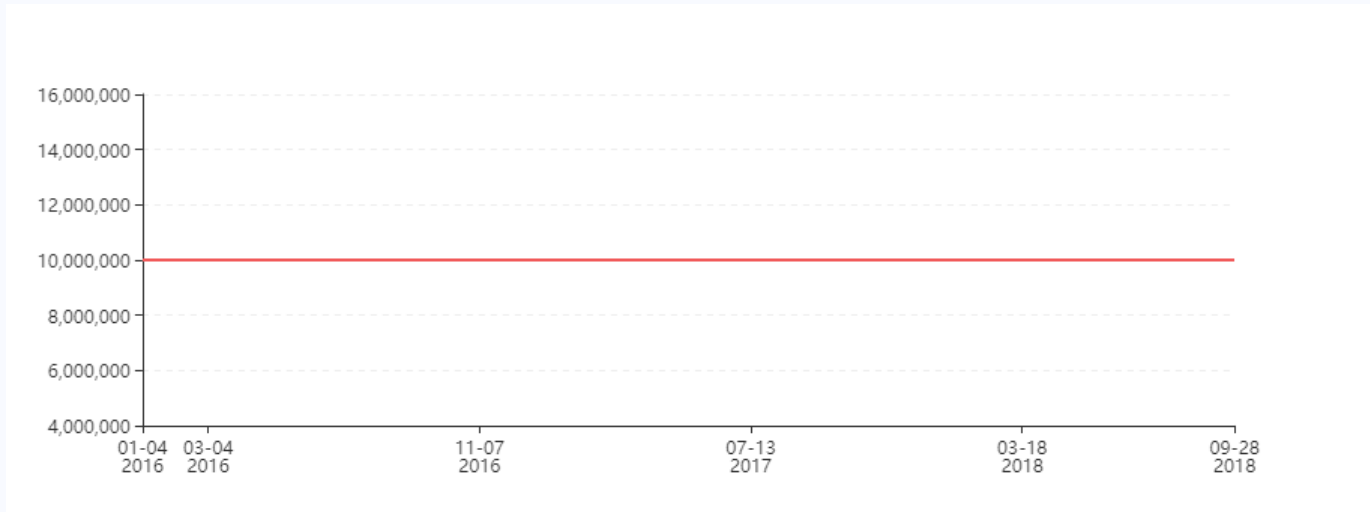
月盈利



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
初始资金收益率	49.91%
净利	4990717.16
毛利	5923788.92
毛损	-933071.76
盈利因子	6.35
多头净利	4990717.16
空头净利	0.00

算术年化收益率	18.74%
几何年化收益率	16.42%
最大回撤	4026103.27
最大回撤率	22.55%
已付手续费	130495.68
已付滑价	0.00
标的个数	202

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
0.79	0.64	1.17	0.00	0.03

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	381.01	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	1440358.22	-1591153.31

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）
786	202	316	470	40.20%	18746.17	-1985.26	9.44	540.47