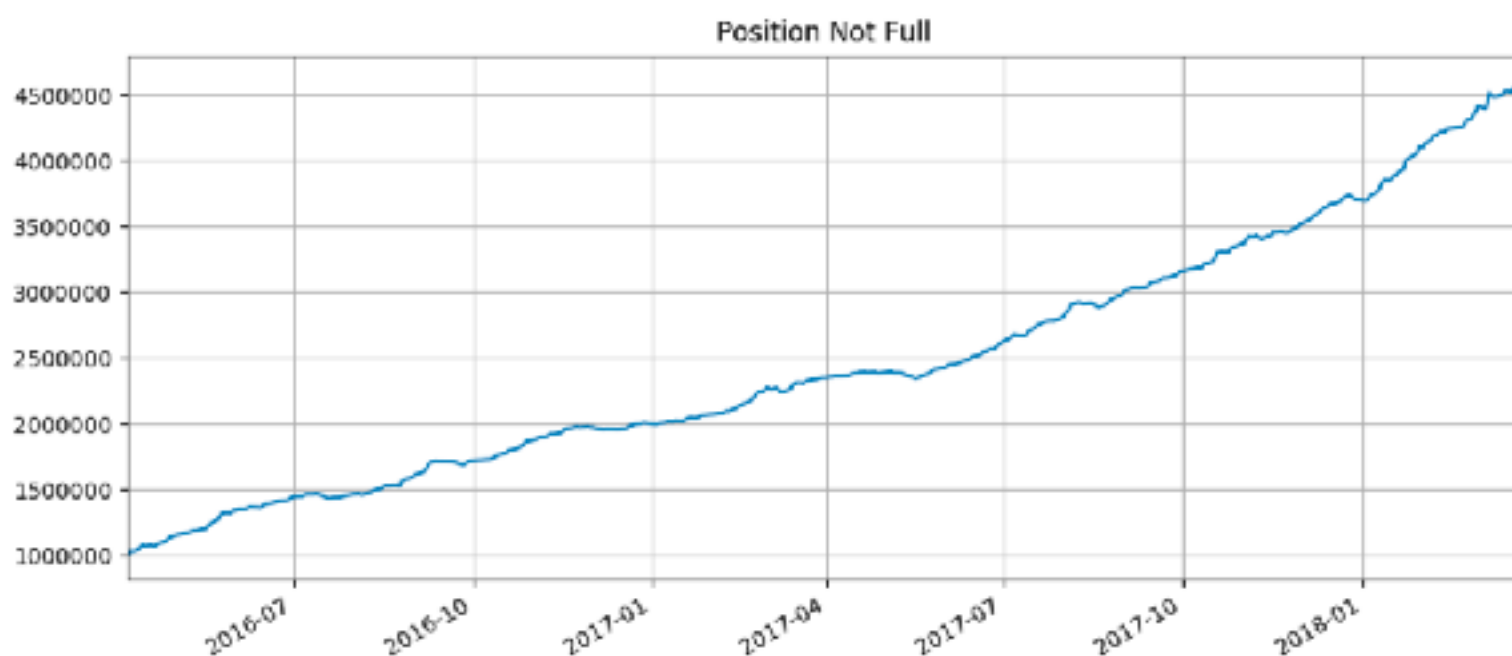


统计套利回测结果

回测标的： 沪深300成分股及沪深300指数

每页下方表格为某日持仓的例子

非满仓操作（平均资金使用率61.9%）



参数	参数值
名称	Position Not Full
年化收益率	123.72%
夏普率	15.9
最大回撤	52651
最大回撤日	2017-05-16
胜率	75.16%
信息比率	147.94%
平均日换手率	27.95%

多头

2016-04-11 00:00:00_002252.SZ,
2016-04-11 00:00:00_002475.SZ,
2016-04-11 00:00:00_600958.SH
2016-04-11 00:00:00_000300,
2016-04-11 00:00:00_000300,
2016-04-11 00:00:00_000300,

空头

2016-04-11 00:00:00_002426.SZ,
2016-04-11 00:00:00_002450.SZ,
2016-04-11 00:00:00_002460.SZ,
2016-04-11 00:00:00_300072.SZ,
2016-04-11 00:00:00_300251.SZ,
2016-04-11 00:00:00_600820.SH

资金用法：

股票多空有9只，投资组合指数多空对冲后，多头有6只（沪深300占3个格子），资金利用率66.6%。

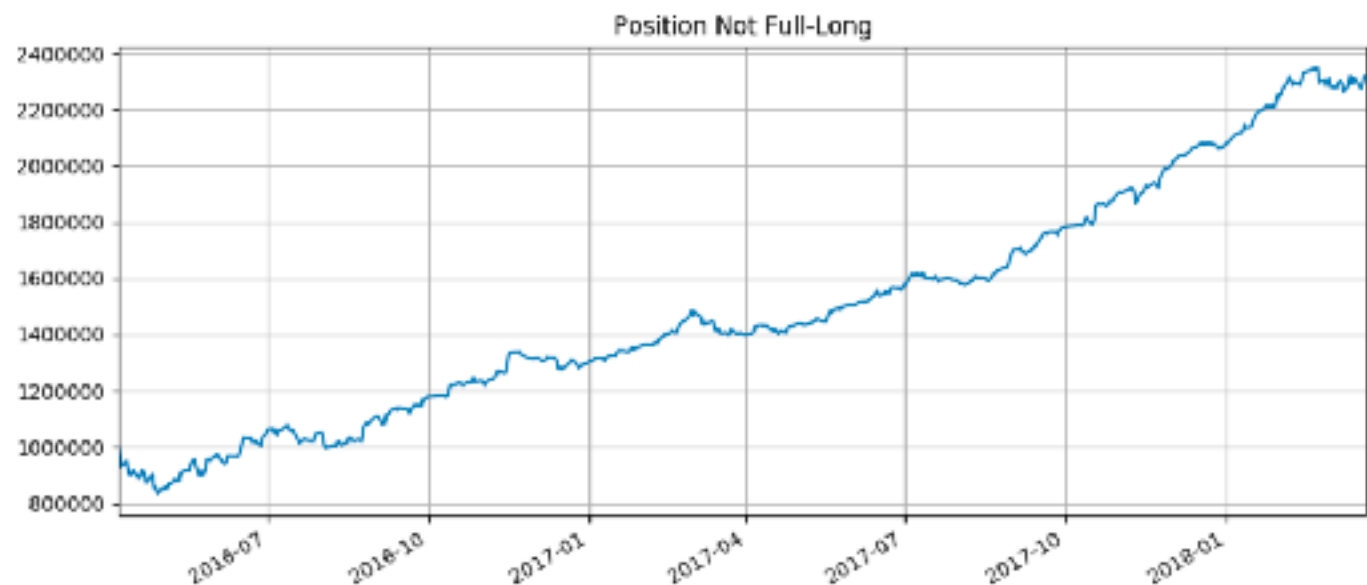
这样做的优点是：

比如某天股票全是多头信号，那么资金利用率100%。

全是空头信号，资金利用率100%。

非满仓操作（多头）

（平均资金使用率61.9%）



参数	参数值
名称	Position Not Full-Long
年化收益率	55.63%
夏普率	2.89
最大回撤	167481
最大回撤日	2016-04-29
胜率	62.21%
信息比率	141.39%
平均日换手率	27.95%

多头

2016-04-11 00:00:00_002252.SZ,
2016-04-11 00:00:00_002475.SZ,
2016-04-11 00:00:00_600958.SH
2016-04-11 00:00:00_000300,
2016-04-11 00:00:00_000300,
2016-04-11 00:00:00_000300,

非满仓操作（空头）

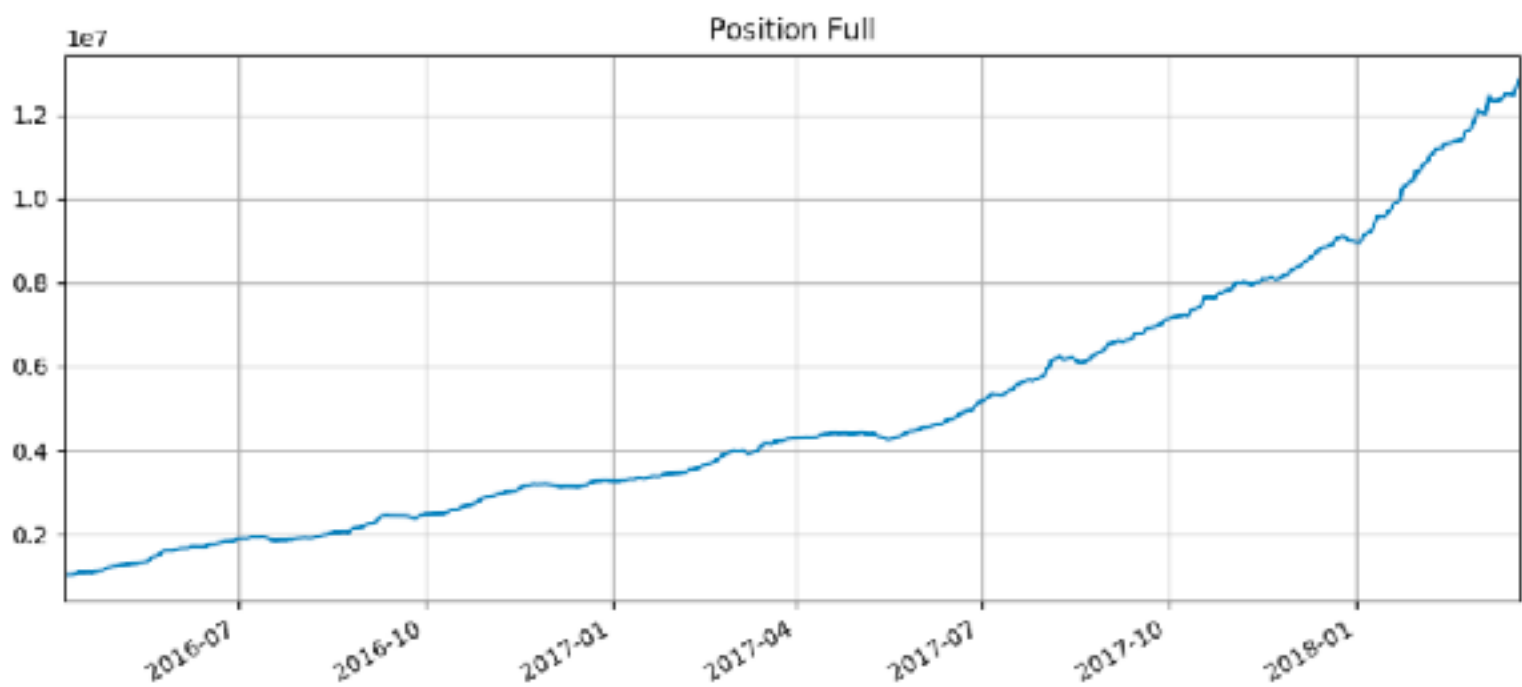


参数	参数值
名称	Position Not Full-Short
年化收益率	36.62%
夏普率	1.73
最大回撤	129019
最大回撤日	2016-06-17
胜率	51.77%
信息比率	160.07%
平均日换手率	27.95%

空头

- 2016-04-11 00:00:00_002426.SZ,
- 2016-04-11 00:00:00_002450.SZ,
- 2016-04-11 00:00:00_002460.SZ,
- 2016-04-11 00:00:00_300072.SZ,
- 2016-04-11 00:00:00_300251.SZ,
- 2016-04-11 00:00:00_600820.SH

满仓操作



+-----+-----+	
参数	参数值
+-----+-----+	
名称	Position Full
年化收益率	283.21%
夏普率	22.7
最大回撤	178099
最大回撤日	2017-05-16
胜率	75.37%
信息比率	146.30%
平均日换手率	27.95%
+-----+-----+	

多头	空头
2016-04-11 00:00:00_002252.SZ,	2016-04-11 00:00:00_002426.SZ,
2016-04-11 00:00:00_002475.SZ,	2016-04-11 00:00:00_002450.SZ,
2016-04-11 00:00:00_600958.SH	2016-04-11 00:00:00_002460.SZ,
2016-04-11 00:00:00_000300,	2016-04-11 00:00:00_300072.SZ,
2016-04-11 00:00:00_000300,	2016-04-11 00:00:00_300251.SZ,
2016-04-11 00:00:00_000300,	2016-04-11 00:00:00_600820.SH

指数的多头空头对冲后，满仓进入。

满仓操作（多头）



+-----+-----+	
参数	参数值
+-----+-----+	
名称	Position Full-Long
年化收益率	107.26%
夏普率	3.56
最大回撤	243478
最大回撤日	2016-04-29
胜率	62.21%
信息比率	140.97%
平均日换手率	27.95%
+-----+-----+	

多头

2016-04-11 00:00:00_002252.SZ,
2016-04-11 00:00:00_002475.SZ,
2016-04-11 00:00:00_600958.SH
2016-04-11 00:00:00_000300,
2016-04-11 00:00:00_000300,
2016-04-11 00:00:00_000300,

满仓操作（空头）

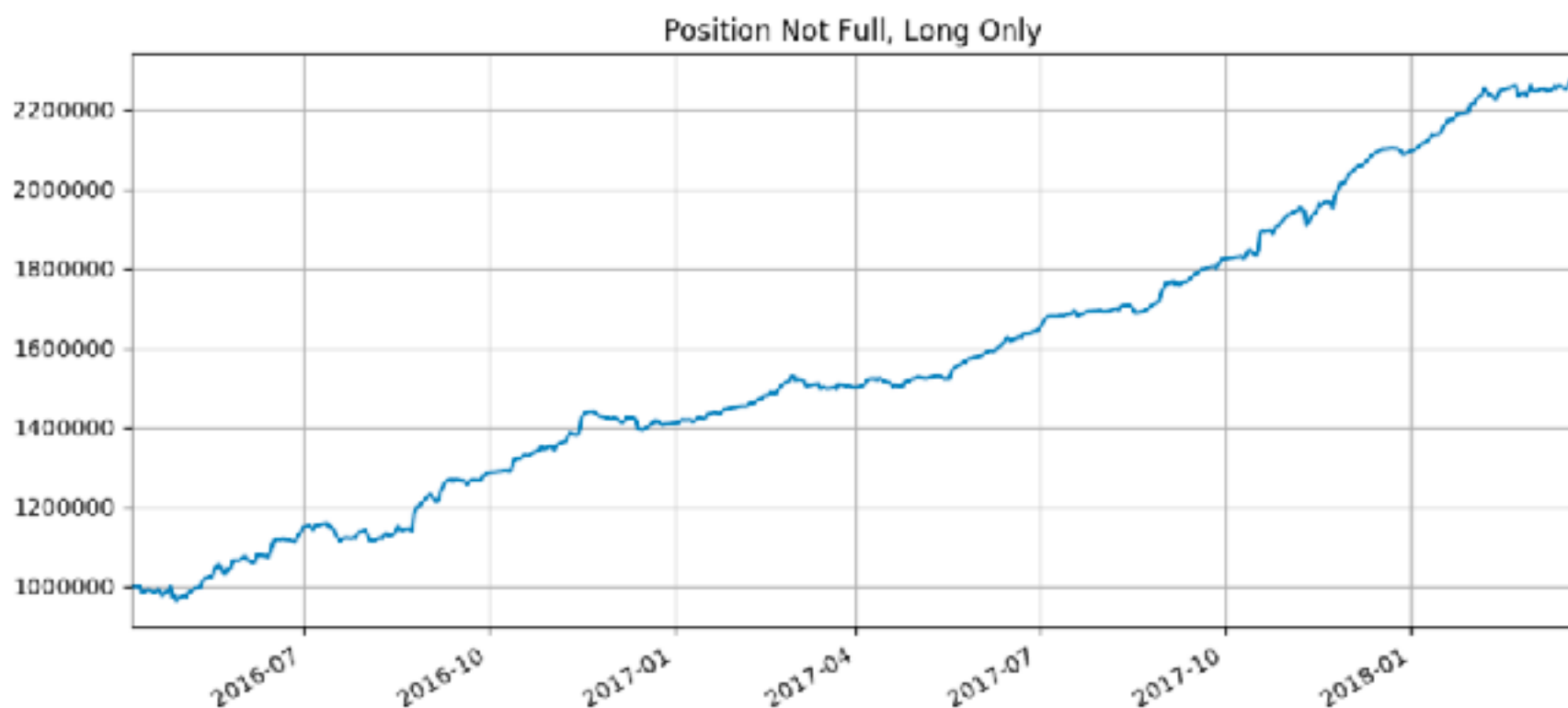


参数	参数值
名称	Position Full-Short
年化收益率	67.63%
夏普率	2.12
最大回撤	270203
最大回撤日	2016-06-17
胜率	52.19%
信息比率	170.35%
平均日换手率	27.95%

空头

2016-04-11 00:00:00_002426.SZ,
2016-04-11 00:00:00_002450.SZ,
2016-04-11 00:00:00_002460.SZ,
2016-04-11 00:00:00_300072.SZ,
2016-04-11 00:00:00_300251.SZ,
2016-04-11 00:00:00_600820.SH

非满仓操作（只做多股票，不多指数，不空）



参数	参数值
名称	Position Not Full, Long Only
年化收益率	54.11%
夏普率	5.15
最大回撤	48584
最大回撤日	2016-12-16
胜率	66.18%
信息比率	143.44%
平均日换手率	27.95%

是目前A股市场可行的操作

多头

2016-04-11 00:00:00_002252.SZ,

2016-04-11 00:00:00_002475.SZ,

2016-04-11 00:00:00_600958.SH

资金用法：

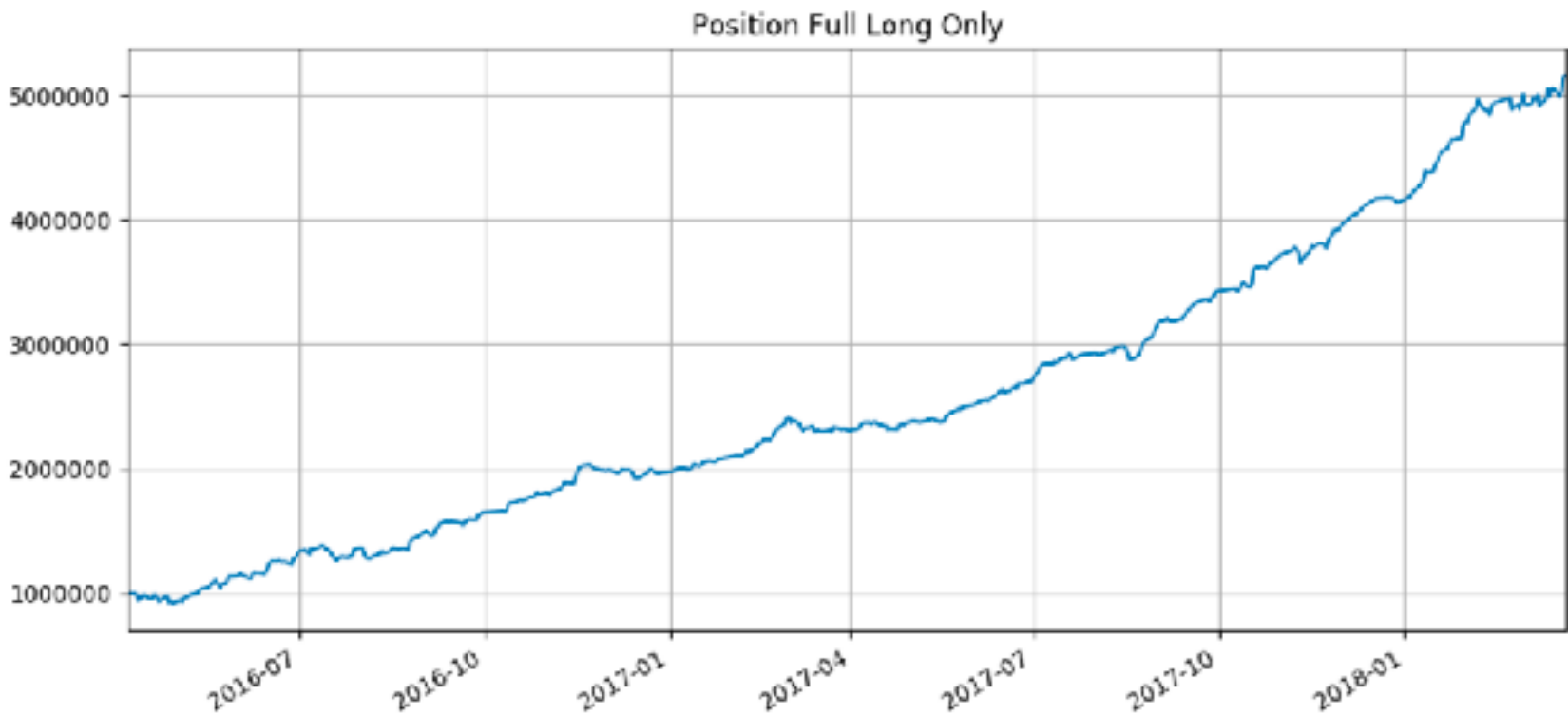
股票多空有9只，投资组合指数多空对冲后，多头有6只（沪深300占3个格子），资金利用率66.6%。

这样做的优点是：

比如某天股票全是多头信号，那么资金利用率100%。

比如某天股票全是空头信号，那么资金利用率0。

满仓操作（只做多股票，不多指数，不空）



参数	参数值
名称	Position Full Long Only
年化收益率	137.15%
夏普率	6.73
最大回撤	119063
最大回撤日	2016-07-19
胜率	66.81%
信息比率	146.02%
平均日换手率	27.95%

也是目前A股市场可行的操作

多头

2016-04-11 00:00:00_002252.SZ,

2016-04-11 00:00:00_002475.SZ,

2016-04-11 00:00:00_600958.SH