***ATM策略***

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 初始投资 | 100,000 | 100,000 |
| 初始可以买合约数 |  | 0.4726 |
| 每个指数点价值 |  | 300 |
| 杠杆率 |  | 12% |
| 仓位 | 100% | 15% |
| 标的 | 50ETF | 股指期货 |
|  | ATM(ETF) | ATM(指数） |
| 允许卖空? | **0** | **1** |
| 复利？ | **1** | **0** |
| 累计收益 | **286,110** | **3,282,524** |
| 年化收益 | **22.56%** | **69.94%** |
| 单日最大回撤 | **-16,425** | **-77,850** |
| 5日最大回撤 | **-33,786** | **-98,966** |
| 10日最大回撤 | **-192,603** | **-180,654** |
| Sharp Ratio | **2.03** | **1.06** |