

EMD-LSTM

业绩走势

累计收益

39.37%

年化收益 13.28%

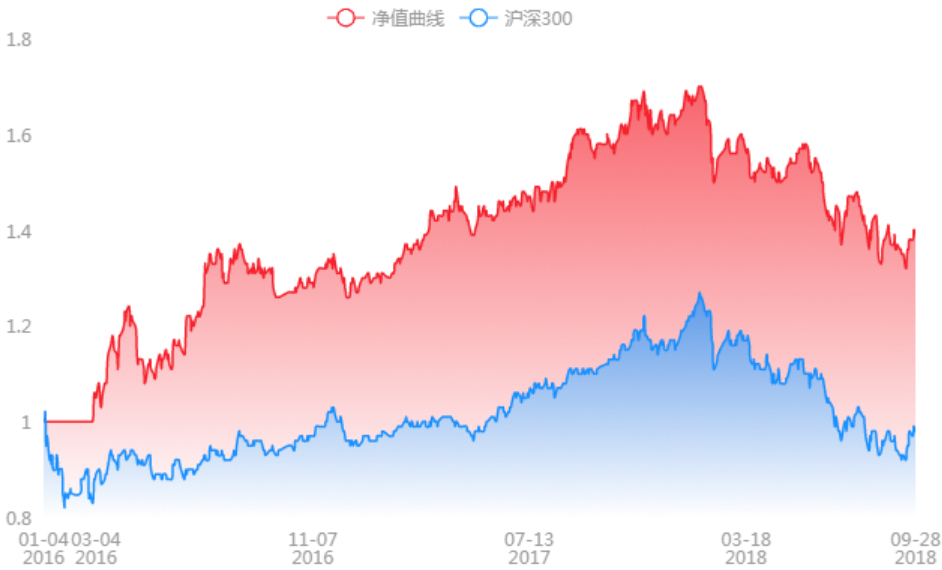
最大回撤 22.54%

初始资金 10000000.00

总资产 13936885.35

起始时间 2016-01-04

终止时间 2018-09-28



策略详情

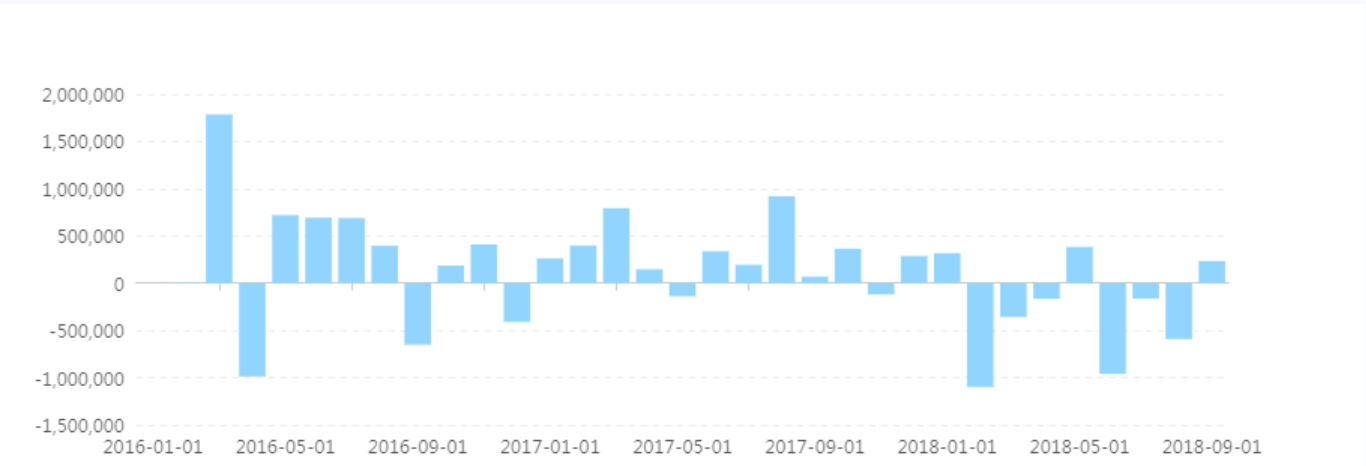
策略信息									
策略名称	年化收益率	基准收益率	阿尔法	贝塔	夏普比率	信息比率	最大回撤	换手率	回测时间
EMD-LSTM	13.28%	-0.87%	0.14	0.54	0.64	0.95	22.54%	427.97%	2016-01-04~2018-09-28

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	5468.25	0.05%	38434.88	32966.64	0	0.00%
2016-03	1785810.65	17.85%	3468591.20	1682780.55	1	100.00%
2016-04	-988325.14	-8.38%	1496670.40	2484995.54	3	66.67%
2016-05	719650.62	6.66%	2783065.96	2063415.34	2	50.00%
2016-06	692937.12	6.01%	2730235.76	2037298.64	3	66.67%
2016-07	689025.51	5.64%	3291637.99	2602612.48	12	75.00%
2016-08	395877.44	3.07%	1912029.46	1516152.02	2	100.00%
2016-09	-651634.33	-4.90%	1507298.97	2158933.30	6	83.33%
2016-10	185240.36	1.46%	711579.29	526338.93	3	66.67%
2016-11	409044.16	3.19%	1678517.26	1269473.10	10	40.00%

2016-12	-410520.95	-3.10%	1625807.05	2036328.00	0	0.00%
2017-01	261103.47	2.03%	1122510.53	861407.06	2	100.00%
2017-02	397510.71	3.04%	1191081.47	793570.76	4	25.00%
2017-03	793605.08	5.88%	2046168.56	1252563.48	1	100.00%
2017-04	146083.55	1.02%	2022605.44	1876521.88	6	66.67%
2017-05	-139150.55	-0.96%	2028693.25	2167843.80	6	50.00%
2017-06	337398.91	2.36%	1598894.48	1261495.57	1	100.00%
2017-07	193891.31	1.33%	2133907.57	1940016.27	5	40.00%
2017-08	919695.84	6.20%	3261507.13	2341811.28	5	60.00%
2017-09	68677.08	0.44%	2230279.07	2161601.99	8	75.00%
2017-10	364092.39	2.30%	1740071.57	1375979.17	2	0.00%
2017-11	-119201.04	-0.74%	3731620.48	3850821.52	8	12.50%
2017-12	287353.02	1.79%	2046915.59	1759562.57	0	0.00%
2018-01	316856.13	1.94%	2494927.82	2178071.69	5	60.00%
2018-02	-1098669.63	-6.59%	1808354.41	2907024.04	4	0.00%
2018-03	-358609.81	-2.30%	1646330.35	2004940.16	3	33.33%
2018-04	-165778.55	-1.09%	1632819.62	1798598.17	5	40.00%
2018-05	382844.74	2.55%	2001355.58	1618510.84	8	62.50%
2018-06	-962115.94	-6.24%	1714853.35	2676969.29	6	16.67%
2018-07	-162799.55	-1.13%	2473392.20	2636191.75	5	20.00%
2018-08	-591259.42	-4.14%	2257475.11	2848734.54	5	20.00%
2018-09	232783.92	1.70%	1813921.23	1581137.31	9	55.56%

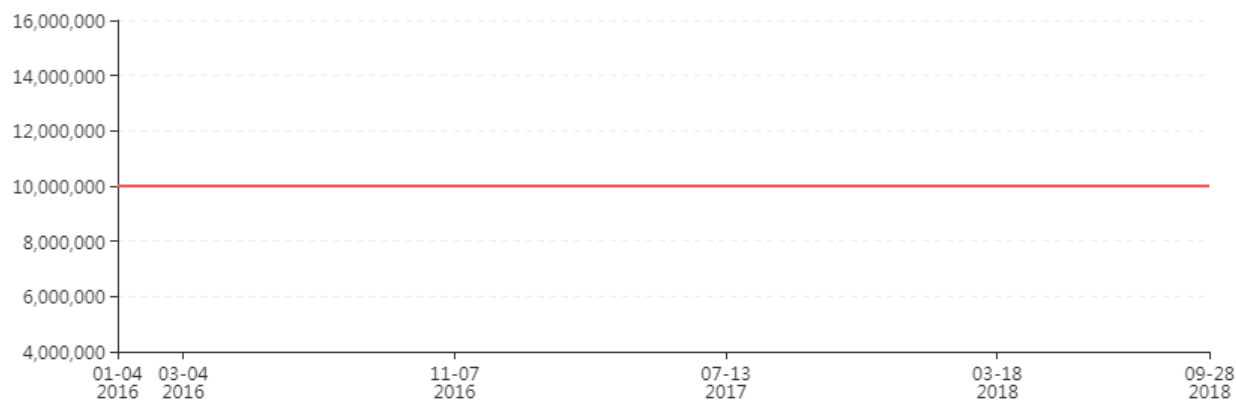
月盈利



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	14.79%
初始资金收益率	39.37%	几何年化收益率	13.28%
净利	3936885.35	最大回撤	3832376.37
毛利	9292723.30	最大回撤率	22.54%
毛损	-5355837.95	已付手续费	979926.01
盈利因子	1.74	已付滑价	0.00
多头净利	3936885.35	标的个数	102
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
0.64	0.50	0.94	0.00	0.25

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	74.34	2018-01-25 ~ 2018-09-17	-382.0

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
38	5	1130535.53	-1012366.82

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）
140	9	71	69	50.71%	130883.43	-77620.84	1.69	58.88