

01/ 基本信息

报告名称: 机器学习(股票)

报告时间: 2025-01-06 12:50:25

报告周期: 2024-07-10 12:46:54 - 2025-01-05 16:00:00

数据来源: 掘金终端回测

02/ 绩效指标

期初资产	期末资金	累计盈亏	累计手续费	累计收益率	基准收益率	超额收益率	年化收益率	最大回撤	胜率
10,000,000.00 元	11,207,189.78 元	1,207,189.78 元	24,988.21 元	12.07 %	14.76 %	-2.68 %	27.31 %	-24.89 %	50.00 %
年化波动率	Alpha	Beta	夏普比率	索提诺比率	卡玛比率	信息比率	特雷诺比率	无风险利率	交易天数
42.91 %	0.20	0.16	0.59	15.96	1.10	-0.12	1.57	2.00 %	118

03/ 净值表现

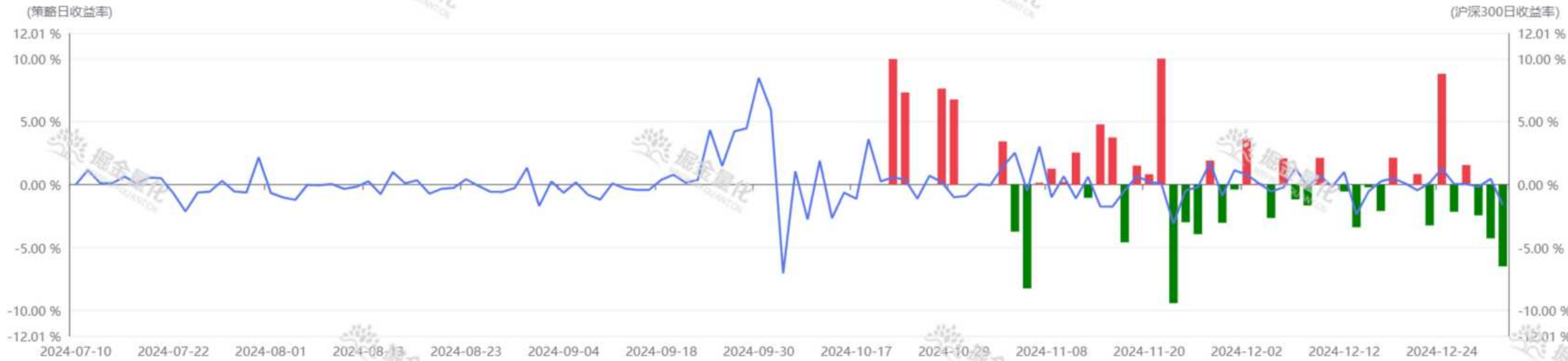
收益图 策略收益 沪深300收益 超额收益



回撤图 策略回撤 沪深300回撤



收益率 策略日收益率 沪深300日收益率



04/ 交易统计

交易统计指标

平仓次数	10	盈利次数	5	亏损次数	5	日胜率	19.49 %	胜率	50.00 %
最大单次盈利	1,801,449.06	平均单次盈利	1,039,019.88	最大单次亏损	-1,117,094.93	平均单次亏损	-585,884.23	盈亏比	1.77
交易天数	118 天	上涨天数	23 天	下跌天数	22 天	最大连续上涨天数	4 天	最大连续下跌天数	4 天
最大回撤持续天数	29 天	最大连续回撤	-24.89 %	最大日回撤	-24.89 %	最大周回撤	-19.30 %	最大月回撤	-17.36 %
最大回撤时段	2024-11-21 ~ 2024-12-31	最长不创新高天数	67 天	单日最大上涨	10.01 %	单日最大下跌	9.42 %	年换手率	40.60 倍