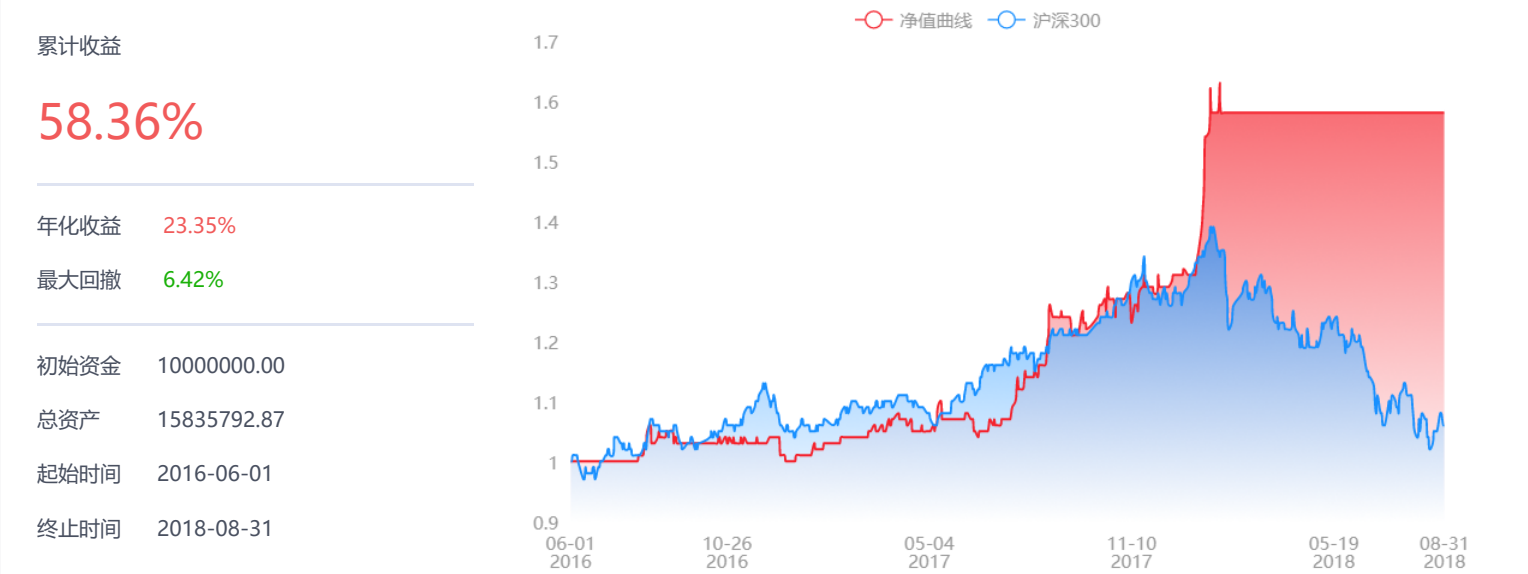


Julius_Knightssl

业绩走势



策略详情

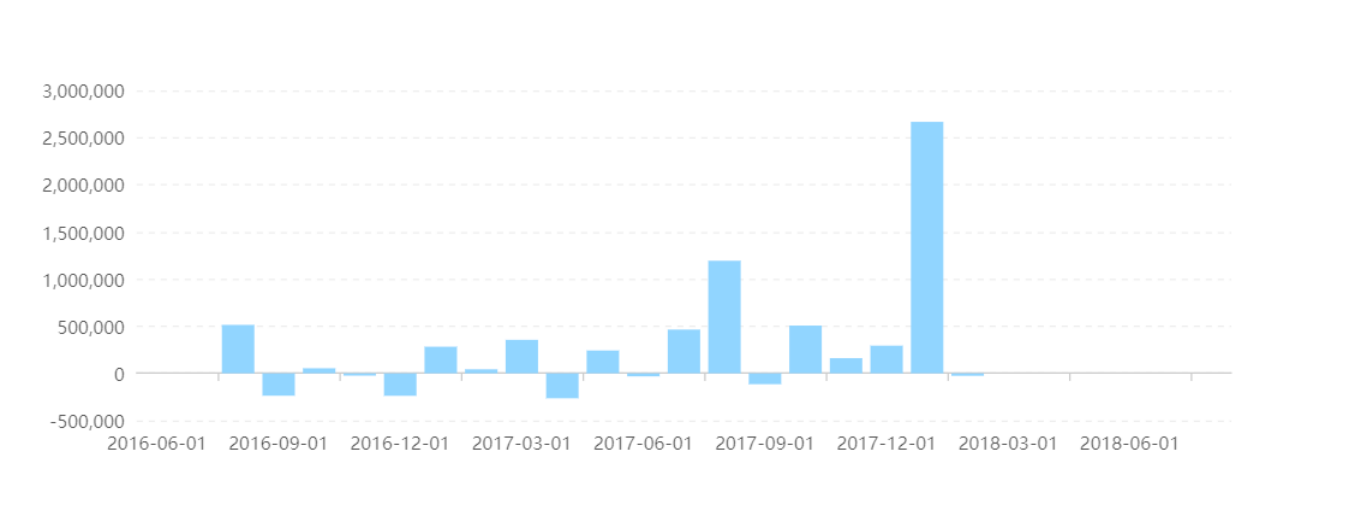
策略信息									
策略名称	年化收益率	基准收益率	阿尔法	贝塔	夏普比率	信息比率	最大回撤	换手率	回测时间
Julius_Knightssl	23.35%	5.50%	0.20	0.09	1.78	1.20	6.42%	1777.68%	2016-06-01~2018-08-31

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
2016-06	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2016-07	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2016-08	513540.28	5.14%	945675.97	432135.69	2	100.00%
2016-09	-237249.03	-2.26%	144191.77	381440.80	3	33.33%
2016-10	53664.56	0.52%	356542.53	302877.97	5	60.00%
2016-11	-24247.03	-0.23%	275518.31	299765.34	5	40.00%
2016-12	-238356.32	-2.31%	302283.49	540639.81	3	33.33%
2017-01	282139.33	2.80%	476227.33	194088.00	5	80.00%
2017-02	42497.76	0.41%	191188.53	148690.77	3	100.00%
2017-03	354974.56	3.42%	606435.00	251460.43	3	100.00%
2017-04	-264578.34	-2.46%	150152.40	414730.74	4	50.00%

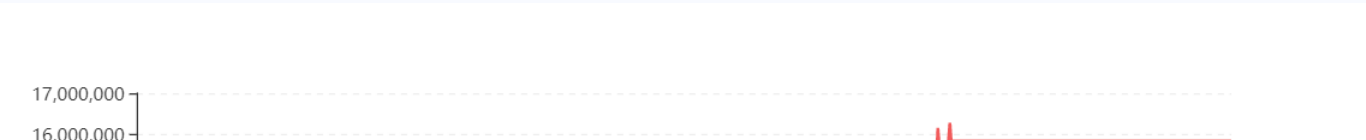
2017-05	242018.44	2.31%	576441.15	334422.71	2	100.00%
2017-06	-31999.77	-0.30%	300897.65	332897.43	2	50.00%
2017-07	463992.29	4.34%	886206.00	422213.71	4	100.00%
2017-08	1193762.46	10.70%	1766554.10	572791.63	4	100.00%
2017-09	-115175.68	-0.93%	654552.33	769728.00	4	75.00%
2017-10	506358.29	4.14%	1259042.98	752684.69	5	80.00%
2017-11	160601.66	1.26%	1086758.39	926156.73	6	50.00%
2017-12	293498.30	2.27%	577783.19	284284.89	2	100.00%
2018-01	2666598.25	20.21%	3150304.73	483706.48	2	100.00%
2018-02	-26247.15	-0.17%	421706.65	447953.80	1	100.00%
2018-03	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2018-04	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2018-05	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2018-06	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2018-07	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2018-08	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%

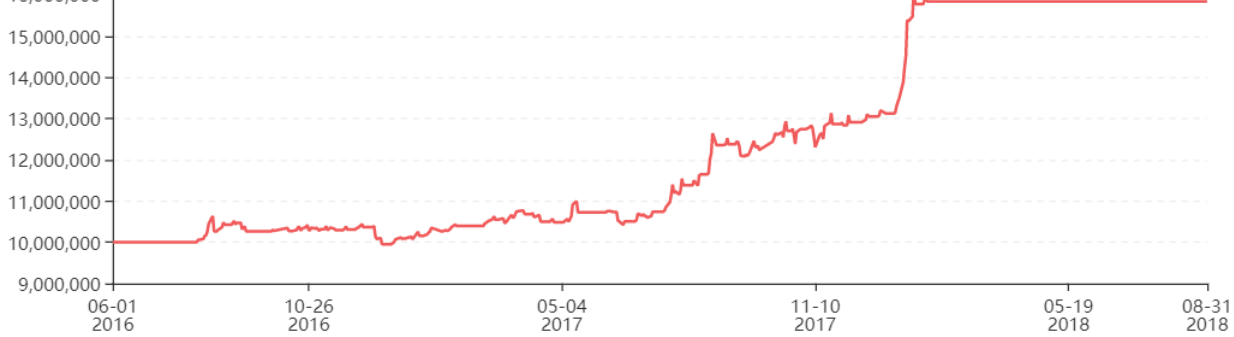
月盈利



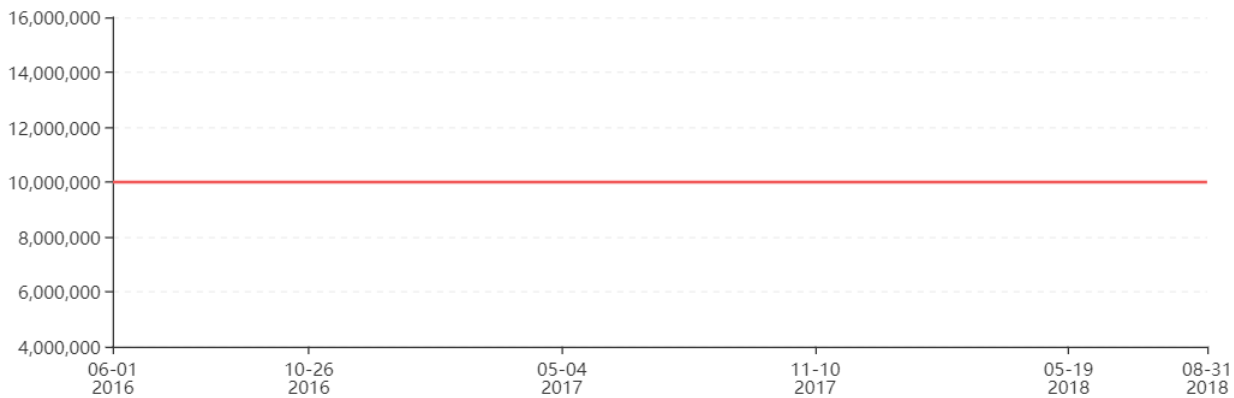
策略分析

多头权益曲线

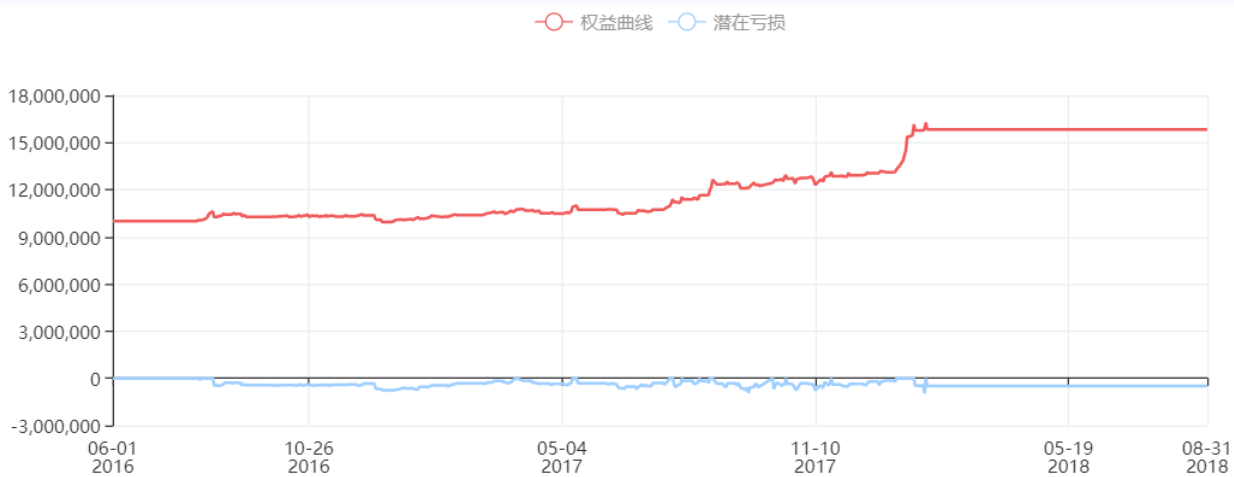




空头权益曲线



权益曲线及潜在亏损



策略绩效概要

初始资金	10000000.00
初始资金收益率	58.36%
净利	5835792.87
毛利	7339157.24
毛损	-1503364.37
盈利因子	4.88
多头净利	5835792.87

算术年化收益率	26.64%
几何年化收益率	23.35%
最大回撤	682936.11
最大回撤率	6.42%
已付手续费	783055.13
已付滑价	0.00
标的个数	1

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
1.78	3.32	3.05	0.00	0.13

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
552	5.95	2016-08-15 ~ 2016-12-22	150.0

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
52	6	2263214.32	-527582.00

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）
65	0	47	18	72.31%	156152.28	-83520.24	1.87	14.18