

# 多行业板块策略回测总结报告

生成时间: 2025-10-19 16:15:37

回测板块数量: 1

总策略数量: 2

## [图表] 市场整体分析

### 市场概况

- 回测板块数量: 1 个
- 总策略数量: 2 个
- 平均总收益率: 2.86%
- 中位数总收益率: 2.86%
- 最佳策略收益率: 8.20%
- 最差策略收益率: -2.48%

### 风险收益指标

- 平均年化收益率: 3.87%
- 平均夏普比率: 0.1940
- 平均最大回撤: -8.05%
- 平均波动率: 10.46%

### 策略表现统计

- 策略胜率: 50.0%
- 超越基准比例: 0.0%
- 正收益策略数量: 1 个
- 负收益策略数量: 1 个

## [板块] 板块分类分析

### 板块分类表现对比

#### 金融

- 包含板块: 1 个
- 策略数量: 2 个
- 平均总收益率: 2.86%
- 平均夏普比率: 0.1940
- 平均最大回撤: -8.05%
- 板块列表: 银行

## [趋势] 行业明细分析

### 行业表现排行榜

#### 1. 银行 (金融)

- 策略数量: 2 个
- 平均总收益率: 2.86%
- 平均夏普比率: 0.1940
- 平均最大回撤: -8.05%
- 最佳策略: MACD (8.20%)
- 最差策略: RSI (-2.48%)

## [排行] 策略表现排行

### 策略表现排行榜 (Top 20)

#### 1. MACD - 银行

- 总收益率: 8.20%
- 年化收益率: 11.02%
- 夏普比率: 0.8230
- 最大回撤: -6.39%
- 交易次数: 8

#### 2. RSI - 银行

- 总收益率: -2.48%
- 年化收益率: -3.27%
- 夏普比率: -0.4349
- 最大回撤: -9.72%
- 交易次数: 2

### 策略类型表现统计

- MACD: 平均收益率 8.20% (共1个实例)
- RSI: 平均收益率 -2.48% (共1个实例)

## [风险] 风险收益分析

### 风险收益分布

#### 收益率分布

- 收益率范围: -2.48% ~ 8.20%
- 收益率标准差: 5.34%
- 收益率偏度: 0.0000
- 收益率峰度: 0.0000

#### 风险分布

- 波动率范围: 7.53% ~ 13.39%

- 平均波动率: 10.46%
- 最大回撤范围: -9.72% ~ -6.39%
- 平均最大回撤: -8.05%

#### 夏普比率分布

- 夏普比率范围: -0.4349 ~ 0.8230
- 平均夏普比率: 0.1940
- 夏普比率中位数: 0.1940

#### 风险收益象限分析

- 高收益高风险: 1 个策略
- 高收益低风险: 0 个策略
- 低收益高风险: 0 个策略
- 低收益低风险: 1 个策略

## [交易] 交易活跃度分析

#### 交易活跃度统计

##### 交易次数分布

- 总交易次数范围: 2 ~ 8
- 平均交易次数: 5.0
- 交易次数中位数: 5.0
- 零交易策略数量: 0

##### 买卖交易分析

- 平均买入次数: 2.5
- 平均卖出次数: 2.5
- 买卖比例: 1.00

##### 交易金额分析

- 总交易金额范围: ¥ 196,884 ~ ¥ 785,056
- 平均交易金额: ¥ 490,970
- 交易金额中位数: ¥ 490,970

##### 策略类型交易活跃度

- MACD: 平均交易次数 8.0
- RSI: 平均交易次数 2.0

## [警告] 异动检测汇总

#### 异动检测汇总

[警告] 共检测到 1 个异动情况：

##### 策略异动 (1个)

- 策略异动: RSI 近两周出现极端表现 (最大单日: 2.35%, 最小单日: 2.35%)

## [建议] 投资建议

### 投资建议

#### 推荐策略 (Top 5)

##### 1. MACD - 银行

- 总收益率: 8.20%
- 夏普比率: 0.8230
- 最大回撤: -6.39%

##### 2. RSI - 银行

- 总收益率: -2.48%
- 夏普比率: -0.4349
- 最大回撤: -9.72%

#### 各行业推荐策略

- 银行: MACD (收益率: 8.20%)