

策略回测结果报告

生成时间: 2025-10-19 16:16:02
行业板块: 银行
回测期间: 20250101 至 20251217
策略数量: 1

[趋势] 分析结论

策略表现分析 - 最佳策略: MACD (总收益率: 8.20%) - 最差策略: MACD (总收益率: 8.20%)
交易活跃度分析 - 活跃策略: 1 个 - 非活跃策略: 0 个 - 最活跃策略: MACD (交易次数: 8)
异动提醒分析 - 未检测到明显异动情况 风险分析 - MACD: 最大回撤 -6.39%, 夏普比率 0.8230

[图表] 综合结果表

最终价值	总收益率	年化收益率	波动率	夏普比率	最大回撤	总交易次数	买入次数	卖出次数	总交易金额	平均交易金额
¥ 114,068	14.07%	19.07%	16.21%	1.1765	-13.77%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
¥ 108,198	8.20%	11.02%	13.39%	0.8230	-6.39%	8	4	4	¥ 785,056	¥ 98,132

[日期] 日收益明细表

日期	板块实际收益率	MACD收益率
2025-01-02	0.00%	0.00%
2025-01-03	-0.91%	0.00%
2025-01-06	0.80%	0.00%
2025-01-07	0.46%	0.00%
2025-01-08	0.64%	0.64%
2025-01-09	-1.02%	-1.02%
2025-01-10	-0.91%	-0.91%
2025-01-13	-1.37%	0.00%
2025-01-14	1.58%	0.00%
2025-01-15	0.44%	0.00%
2025-01-16	1.39%	0.00%
2025-01-17	-0.41%	-0.41%
2025-01-20	-0.02%	-0.02%
2025-01-21	-0.11%	-0.11%
2025-01-22	-1.79%	-1.77%

2025-01-23	2.43%	2.40%
2025-01-24	0.20%	0.20%
2025-01-27	1.49%	1.48%
2025-02-05	-1.54%	-1.52%
2025-02-06	0.11%	0.11%

注：仅显示前20行，共190行数据

[图表] 日收益统计摘要

指标	平均日收益率	最大日收益率	最小日收益率	正收益天数	负收益天数
板块实际收益率	0.07%	2.43%	-5.72%	97天	92天
MACD收益率	0.04%	2.40%	-5.65%	58天	55天

[趋势] 累计收益明细表

日期	板块累计收益率	MACD累计收益率
2025-01-02	0.00%	0.00%
2025-01-03	-0.91%	0.00%
2025-01-06	-0.12%	0.00%
2025-01-07	0.34%	0.00%
2025-01-08	0.98%	0.64%
2025-01-09	-0.05%	-0.39%
2025-01-10	-0.97%	-1.29%
2025-01-13	-2.32%	-1.29%
2025-01-14	-0.78%	-1.29%
2025-01-15	-0.35%	-1.29%
2025-01-16	1.04%	-1.29%
2025-01-17	0.63%	-1.69%
2025-01-20	0.61%	-1.71%
2025-01-21	0.49%	-1.82%
2025-01-22	-1.30%	-3.56%
2025-01-23	1.09%	-1.24%
2025-01-24	1.29%	-1.04%
2025-01-27	2.81%	0.42%
2025-02-05	1.23%	-1.11%
2025-02-06	1.34%	-1.00%

注：仅显示前20行，共190行数据

[图表] 累计收益统计摘要

指标	最终累计收益率	最大累计收益率	最小累计收益率	累计收益波动	收益稳定性
板块累计收益率	14.07%	25.15%	-2.32%	27.47%	波动
MACD累计收益率	8.20%	14.98%	-5.44%	20.42%	波动