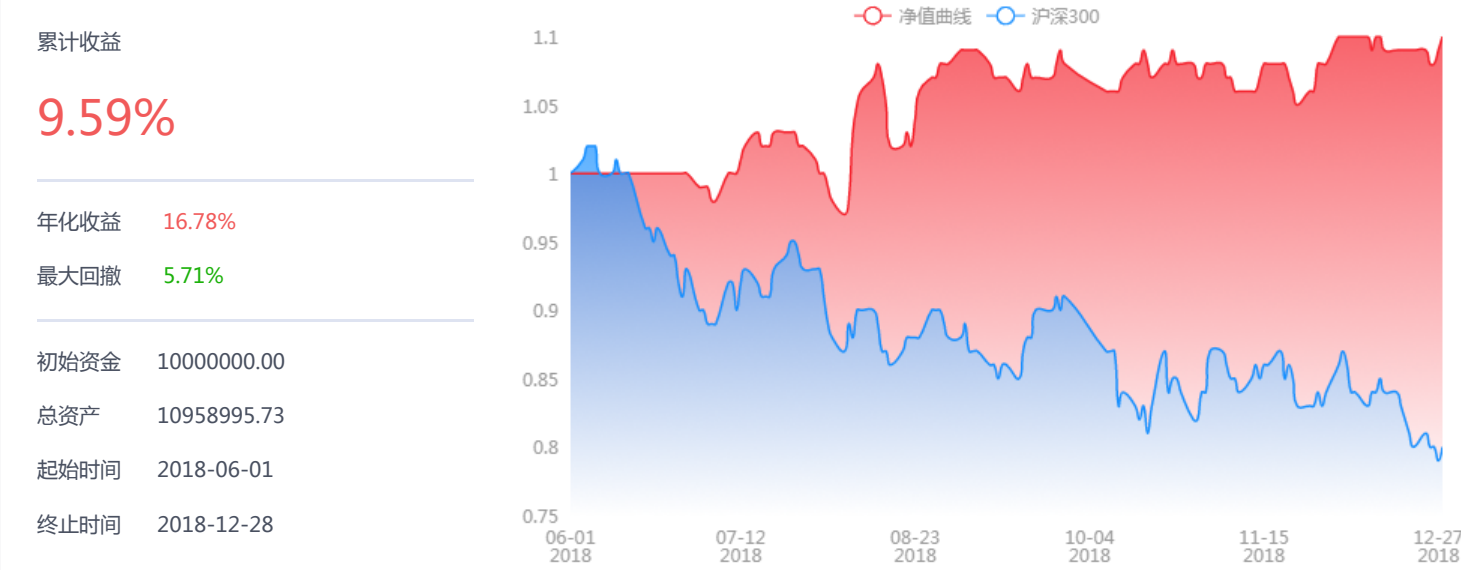


Future_Arbitrage

业绩走势



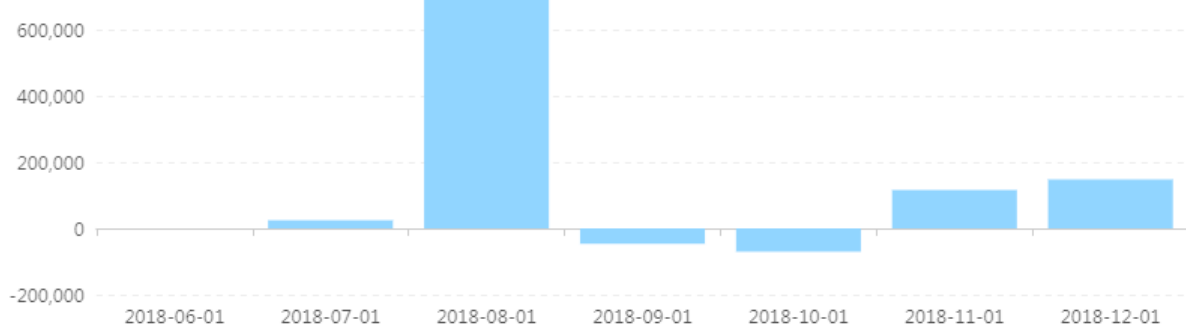
策略详情

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
Future_Arbitrage	16.78%	-20.15%	0.22	0.18	1.18	2.21	5.71%	1011.29%	2018-06-01~2018-12-28

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
2018-06	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2018-07	24451.84	0.24%	2528181.58	2503729.74	258	51.94%
2018-08	787778.44	7.86%	4229725.21	3441946.77	291	53.95%
2018-09	-46506.84	-0.43%	2620261.96	2666768.80	273	49.45%
2018-10	-70223.37	-0.65%	3033257.52	3103480.89	246	52.03%
2018-11	115823.65	1.08%	3628576.05	3512752.39	302	50.33%
2018-12	147672.02	1.37%	3047979.78	2900307.76	300	51.33%

月盈利	
800,000	



策略分析

多头权益曲线

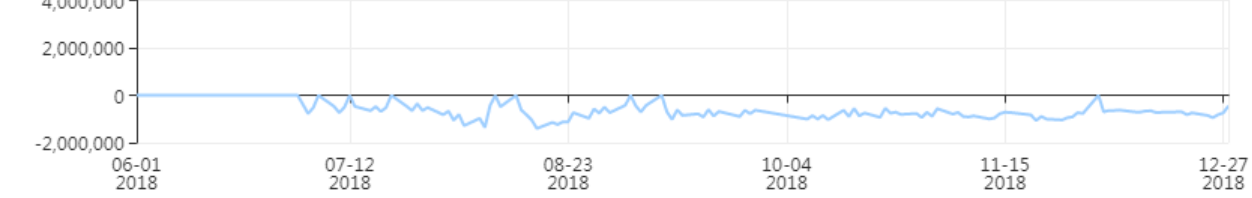


空头权益曲线



权益曲线及潜在亏损





策略绩效概要

初始资金	10000000.00	算术年化收益率	16.78%
初始资金收益率	9.59%	几何年化收益率	17.38%
净利	958995.73	最大回撤	588818.82
毛利	15482606.05	最大回撤率	5.71%
毛损	-14523610.31	已付手续费	395594.27
盈利因子	1.07	已付滑价	0.00
多头净利	-532912.75	标的个数	23
空头净利	1491908.48		

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
1.18	2.69	2.02	0.00	0.41

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
144	1.70	2018-07-25 ~ 2018-08-06	11.0

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
9	21	1055872.51	-588818.82

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）
1670	20	861	809	51.56%	17982.12	-17952.55	1.00	24.92