

## 账户分析报告

资金账号: XXXXXXXX 客户名称: XX

### 一、账户总览

累计单位净值走势图

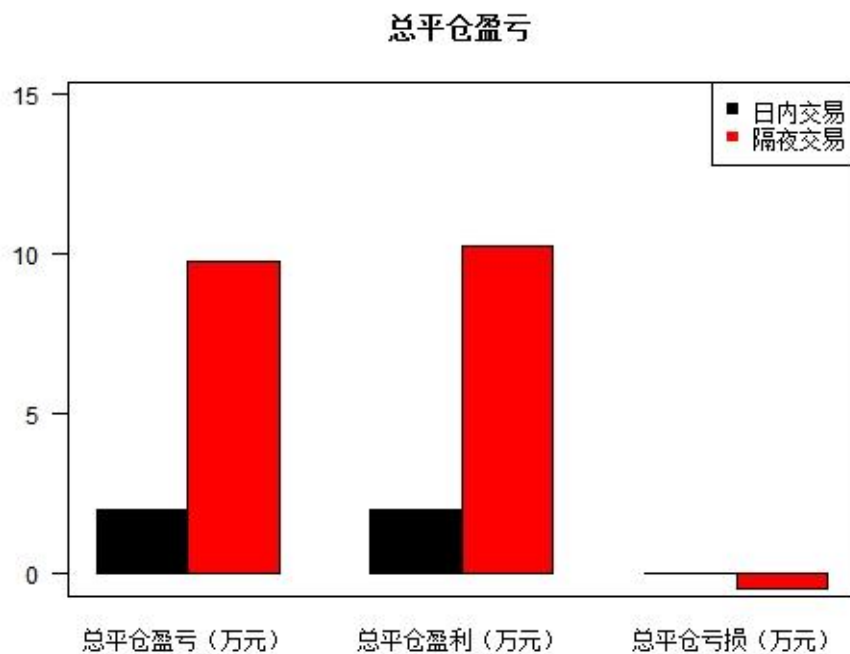


分析期间内账户情况总览	
开始日期	2019-12-3
结束日期	2019-12-31
期初权益	661022.81 (元)
期末权益	2632184.54 (元)
净入金	2349935 (元)
总盈亏	-376585 (元)
盈亏率	-12.51 %

主要交易品种	沪深 300 指数, 黄金, 铝, 燃料油, 铜, 甲醇, 镍
最大回撤	19.31%
盈利天数	8
亏损天数	13
最大连续盈利天数	4
最大连续亏损天数	4
最长不创新高天数	20
夏普比率	-5.06
索提诺比率	-4.42

## 二、交易方式分析

### 1. 总平仓盈亏



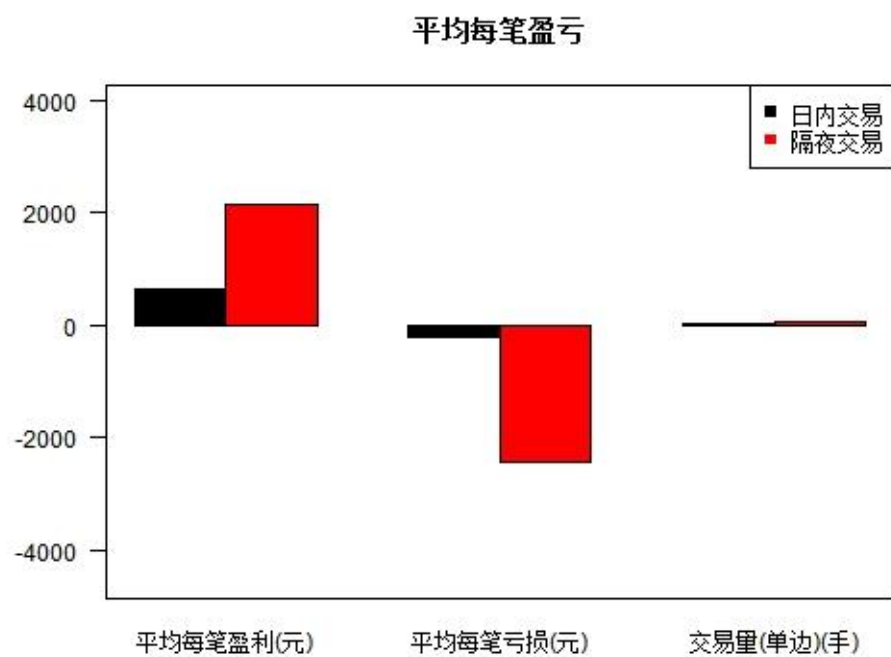
日内交易的总平仓盈亏为盈利 1.96 万元，其中盈利 1.98 万元，亏损-0.02 万元。

隔夜交易的总平仓盈亏为盈利 9.79 万元，其中盈利 10.28 万元，亏损-0.49 万元。

### 2. 胜率

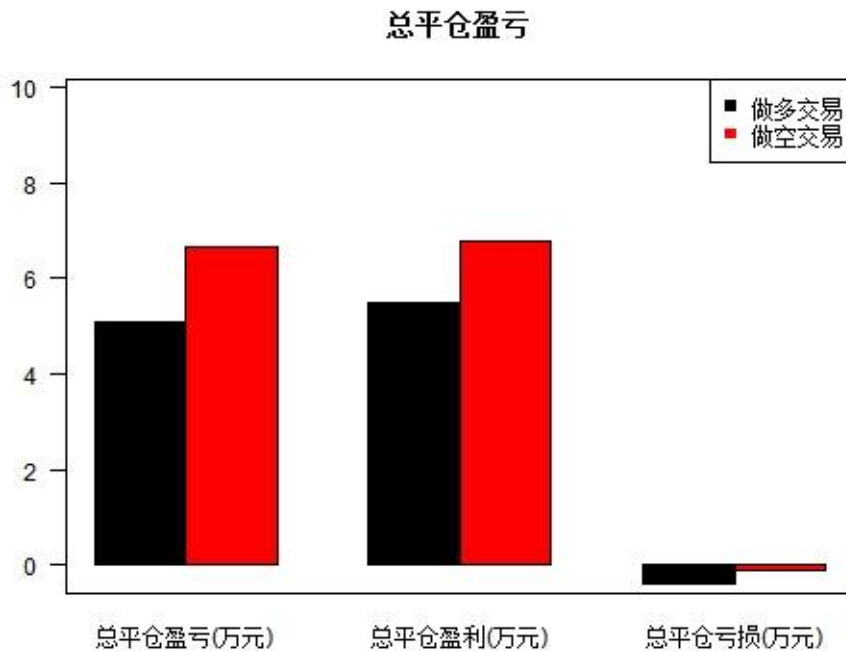
	日内交易	隔夜交易
胜(次)	30	48
败(次)	1	2
胜率(%)	96.77 %	96 %

### 3. 每笔盈亏



### 三、交易方向分析

#### 1. 总平仓盈亏



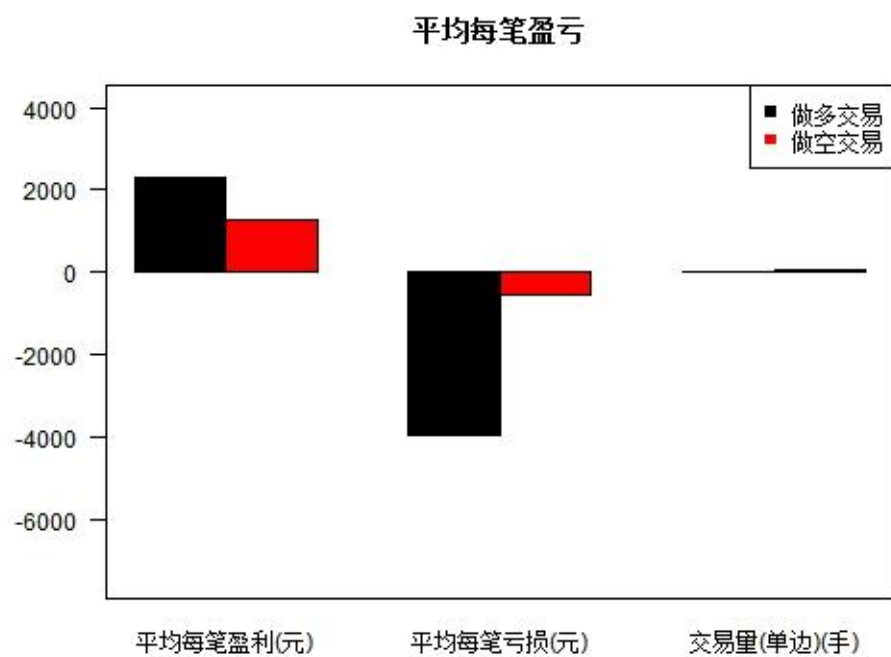
做多交易的总平仓盈亏为盈利 5.07 万元，其中盈利 5.47 万元，亏损-0.4 万元。

做空交易的总平仓盈亏为盈利 6.68 万元，其中盈利 6.79 万元，亏损-0.11 万元。

#### 2. 胜率

	做多交易	做空交易
胜(次)	24	54
败(次)	1	2
胜率(%)	96 %	96.43 %

### 3. 每笔盈亏



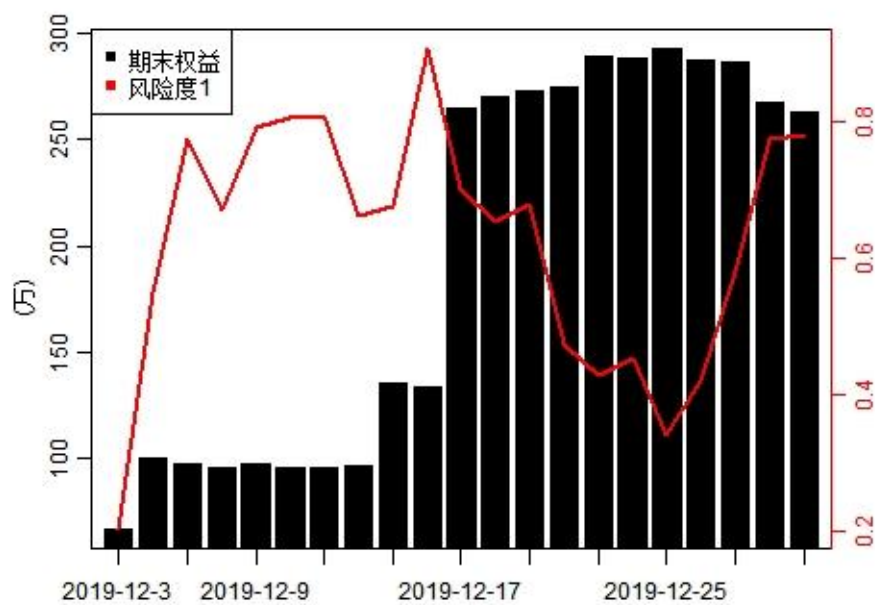
#### 四、品种偏好分析

品种	交易量占比	胜率	总平仓盈亏 (元)
沪深 300 指数	24.39 %	90 %	70680
黄金	36.59 %	100 %	32670
铝	1.22 %	100 %	100
燃料油	2.44 %	100 %	230
铜	4.88 %	100 %	3000
甲醇	4.88 %	100 %	620
镍	25.61 %	95 %	10200

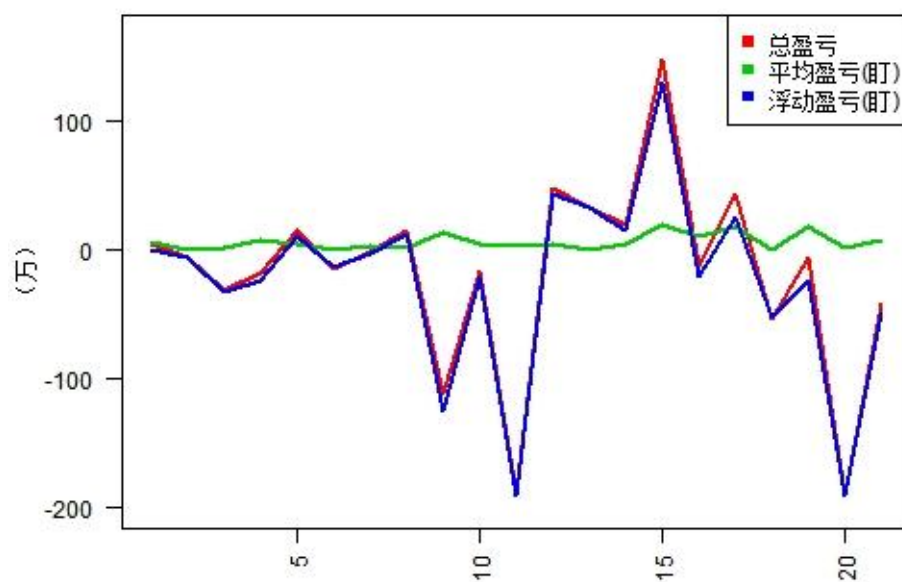
(注：此处的总平仓盈亏指已平仓仓单的盈亏额总和，未平仓仓单的浮动盈亏未包含在内)

## 五、交易风险度分析

权益及风险度变化图

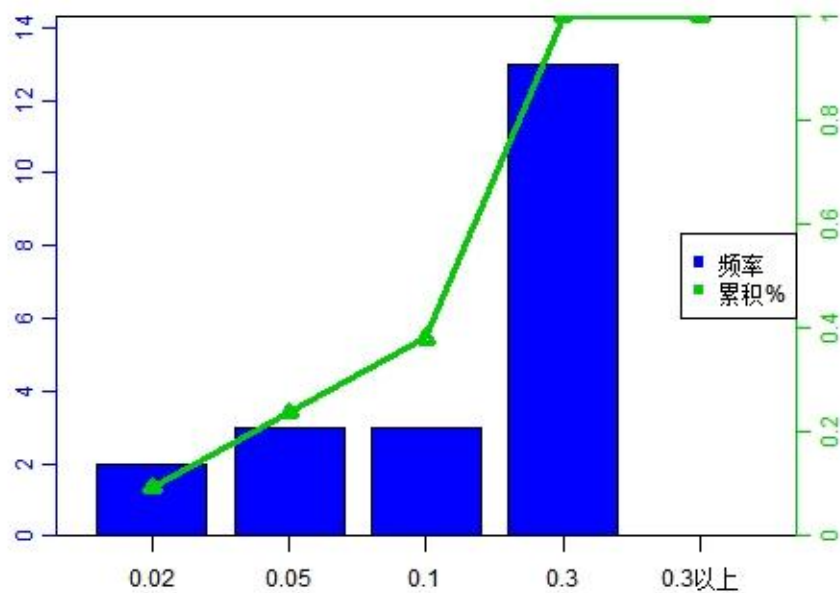


累计盈亏变化图





回撤率分布图



持仓的平均风险度为 62.63%，最大风险度为 90.76%。

资金平均回撤幅度为 10.37%，最大回撤幅度为 19.31%。