

交易策略性能测试报告

笔记本： 我的第一个笔记本

创建时间： 2020/7/11 15:28

更新时间： 2020/7/11 15:28

作者： anonymous

URL: <http://bbs.tb18.net/thread-21309-1-1.html>

交易策略性能测试报告

净利润： 绝对值（总盈利金额 - 总亏损金额）（盈利为黑色数字，亏损为红色）

总盈利： 总交易盈利金额 - 手续费

总亏损： 绝对值（总交易亏损金额 - 手续费）显示为红色

总盈利/总亏损： 绝对值（总盈利 / 总亏损）

交易手数： 总的交易数量

盈利比率： 盈利手数 / 总交易手数

盈利手数： 盈利交易的总手数

亏损手数： 亏损交易的总手数

持平手数： 持平交易的总手数

平均利润： 净利润 / 交易手数

平均盈利： 总盈利金额 / 盈利交易手数

平均亏损： 总亏损金额 / 亏损交易手数（显示为红色）

平均盈利/平均亏损： 绝对值（平均盈利/平均亏损）

最大盈利： 盈利最大的单次交易的盈利金额

最大亏损： 绝对值（亏损最大的单次交易的亏损金额）

最大盈利/总盈利： 如字面所示

最大亏损/总亏损： 如字面所示

净利润/最大亏损： 如字面所示

最大连续盈利手数： 若将手数设为固定一手，则此手数也就是最大连续盈利次数

大连续亏损手数： 若将手数设为固定一手，则此手数也就是最大连续亏损次数

平均持仓周期： 总交易的bar的总数 / 交易次数

平均盈利周期： 总盈利交易的bar的总数 / 盈利交易次数

平均亏损周期： 总亏损交易的bar的总数 / 亏损交易次数

平均持平周期： 总持平交易的bar的总数 / 持平交易次数

最大使用资金： 以bar的收盘价来计算的最大持仓保证金（组合测试时为多个策略共同 计算的最大使用资金量）

佣金合计： 总共的佣金金额

收益率： 净利润 / 初始资金

年度收益率： 有效收益率 / （总交易的天数 / 365）

有效收益率： 净利润 / 最大使用资金

月度平均盈利： $\text{净利润} / \text{总交易的天数} \times 30.5$

收益曲线斜率： 根据交易盈亏曲线拟合的趋势线的斜率

收益曲线截距： 根据交易盈亏曲线拟合的趋势线的截距

收益曲线R平方值： 根据交易盈亏曲线拟合的趋势线与收益曲线之间相关系数的平方（具体计算方式可查阅EXCLE表格中R平方值的算法）

总交易时间： 参与测试的全部bar数据的天数

持仓时间比率： $\text{持仓BAR数量} / \text{总bar数量}$

持仓时间： $\text{总交易时间} \times \text{持仓时间比率}$

最大空仓时间： 没有持仓的天数

持仓周期： 持仓的BAR数量

资产最大升水： $\text{最高点金额} - \text{前期低点的金额}$

发生时间： 高点发生的所在BAR的日期与时间

最大升水/前期低点： 如字面所示

最大资产回撤值（按Bar收盘计算）

回撤值： $\text{前期高点} - \text{低点}$

发生时间： 低点发生所在bar的日期与时间

回撤值/前期高点： $(\text{前期高点} - \text{低点}) / \text{前期高点}$

净利润/回撤值： $\text{净利润} / \text{回撤值}$

最大资产回撤值比例（按Bar收盘计算）

回撤值： $\text{前期高点} - \text{低点}$

发生时间： 低点发生所在bar的日期与时间

回撤值/前期高点： $(\text{前期高点} - \text{低点}) / \text{前期高点}$

净利润/回撤值： $\text{净利润} / \text{回撤值}$ 注意：上述两个回撤的区别在于，前者是按回撤金额的最大值来计算，而后者是按回撤比例的最大值来计算的。比如说，一个原始金额

为10万的帐户，在刚开始交易的一段时间就发生了一个4万的回撤。而此帐户在交易一段时间后，总金额增长到了50万，此时发生了一个8万的回撤。如果

以金额回撤来计算，是后面这个8万的回撤大。但是以比例来计算，则是前面那个4万的回撤大。交易策略参数优化报告

净利润： $\text{绝对值} (\text{总盈利金额} - \text{总亏损金额})$

年化收益： $\text{净利润} / \text{总交易的天数} \times 365$

盈利比率： $\text{盈利手数} / \text{总交易手数}$

平均利润： $\text{净利润} / \text{交易手数}$

交易手数： 总交易手数

最大资产回撤： $\text{低点} - \text{前期高点}$

TB系数： $\text{头寸系数} \times \text{年化收益} / \text{最大使用资金}$

增长系数： 根据交易盈亏曲线拟合的趋势线的斜率

收益风险比： $\text{年度收益} / \text{最大资产回撤}$

R平方值： 根据交易盈亏曲线拟合的趋势线与收益曲线之间相关系数的平方（具体计算方式可查阅EXCLE表格中R平方值的算法）

置信度： 根据测试的交易次数计算的置信水平，计算公式为： $1 - 1/\text{Sqrt}(\text{交易次数})$;

头寸系数： $\text{盈利比率} - (100 - \text{盈利比率}) / \text{盈亏比}$

资产回撤计数： 资产回撤发生的次数（是以超过最大回撤基准线以上的回撤来计算的，此基准线在“全局交易设置中”进入设置）

平均资产回撤： 资产回撤总金额 / 资产回撤计数（都是以超过最大回撤基准线以上的回撤来计算的，此基准线在“全局交易设置中”进入设置）

调整收益风险比： 年度收益 / 平均资产回撤 (年度收益 = 净利润 / 总交易时间 * 365)

夏普比率： 量化收益与风险的比值，具体算法参考互联网上的夏普比率计算方法

盈亏比： 平均盈利 / 平均亏损

总盈利： 总交易盈利金额 - 手续费

总亏损： 总交易亏损金额 - 手续费

盈利手数： 盈利交易的总手数

亏损手数： 亏损交易的总手数

连续盈利手数： 如字面所示

连续亏损手数： 如字面所示

最大盈利： 盈利最大的单次交易的盈利金额

最大亏损： 亏损最大的单次交易的亏损金额

平均盈利： 总盈利 / 盈利交易手数

平均亏损： 总亏损金额 / 亏损交易手数

平均盈利周期： 总盈利交易的bar的总数 / 盈利交易手数

平均亏损周期： 总亏损交易的bar的总数 / 亏损交易手数

盈利因子： 总利润 / 总亏损

最大资产回撤比率%： 最大资产回撤 / 前期高点

平仓效率总效率 = (平仓价 - 开仓价) / (最佳平仓价 - 最佳开仓价)

建仓效率 = (最佳平仓价 - 开仓价) / (最佳平仓价 - 最佳开仓价)

平仓效率 = (平仓价 - 最佳开仓价) / (最佳平仓价 - 最佳开仓价)