策略模拟收益日报 20180809

**1. 选出股票列表：用于20180810日开盘买入**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 418 | 小天鹅A | 300584 | 海辰药业 |
| 2205 | 国统股份 | 300588 | 熙菱信息 |
| 2209 | 达意隆 | 300607 | 拓斯达 |
| 2213 | 特尔佳 | 300643 | 万通智控 |
| 2243 | 通产丽星 | 300656 | 民德电子 |
| 2511 | 中顺洁柔 | 300668 | 杰恩设计 |
| 2580 | 圣阳股份 | 300679 | 电连技术 |
| 2840 | 华统股份 | 300691 | 联合光电 |
| 2883 | 中设股份 | 300698 | 万马科技 |
| 2884 | 凌霄泵业 | 300703 | 创源文化 |
| 2887 | 绿茵生态 | 300709 | 精研科技 |
| 2890 | 弘宇股份 | 300713 | 英可瑞 |
| 2920 | 德赛西威 | 600329 | 中新药业 |
| 2929 | 润建通信 | 600345 | 长江通信 |
| 300134 | 大富科技 | 600821 | 津劝业 |
| 300232 | 洲明科技 | 600853 | 龙建股份 |
| 300323 | 华灿光电 | 601958 | 金钼股份 |
| 300336 | 新文化 | 603063 | 禾望电气 |
| 300428 | 四通新材 | 603286 | 日盈电子 |
| 300458 | 全志科技 | 603329 | 上海雅仕 |
| 300476 | 胜宏科技 | 603458 | 勘设股份 |
| 300507 | 苏奥传感 | 603595 | 东尼电子 |
| 300527 | 中国应急 | 603605 | 珀莱雅 |
| 300537 | 广信材料 | 603607 | 京华激光 |
| 300554 | 三超新材 | 603900 | 莱绅通灵 |

**2. 模拟策略收益指标统计: 费用设为双边千三**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 累计收益率 | 年化收益率 | 年化波动率 | 最大回撤 | 夏普比率 |
| 当日 | 3.1% |  |  |  |  |
| 当周 | 2.55% | 156.14% | 45.08% | -2.24% | 3.4638 |
| 当月 | -2.0% | -70.04% | 36.84% | -5.86% | -1.9012 |
| 当年 | 31.97% | 52.93% | 26.31% | -10.63% | 2.0114 |

注：年化收益计算默认每年245个交易日

**3. 最近一年模拟策略收益净值曲线:**

