

DC6220e6g1_kdj_9_3_3 策略

回测报告

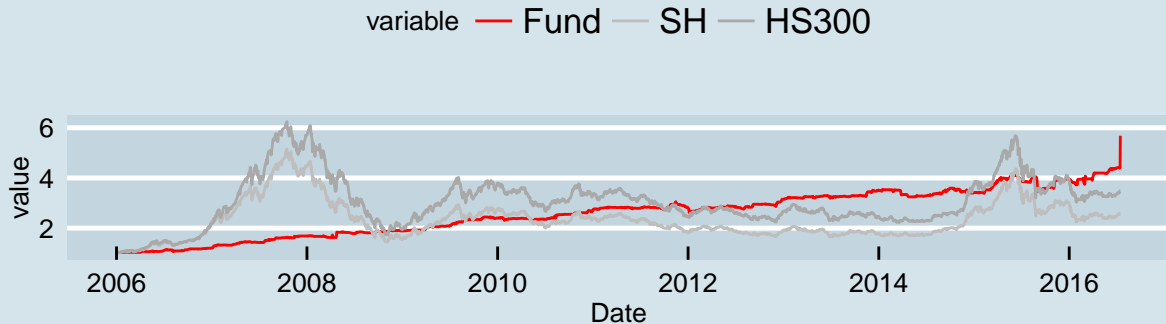
2016 年 10 月 12 日



基金净值

项目	回测开始	回测结束
日期	2006-01-04	2016-07-15
资金规模	50,000,000	283,986,038
总收益	467.97%	
年化收益	18.49%	

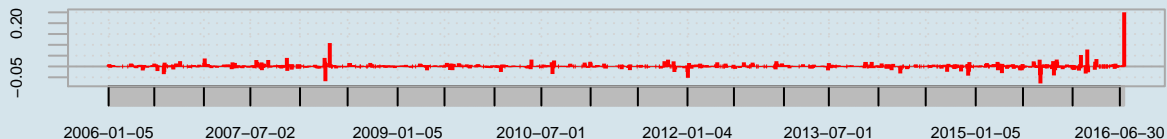
Net Value



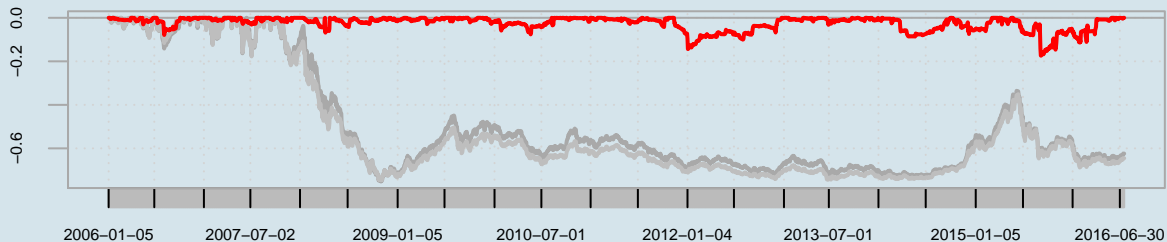
交易情况

交易次数	4954	盈利总额	72,502,901	单笔平均盈利	21,930	最大回撤额	34,969,298
盈利次数	3306	亏损总额	-36,642,123	单笔平均亏损	-22,234	最大回撤比	16.84%
胜率	66.73%	盈利比	1.98	赔率	0.99	年化收益/最大回撤比	1.10

Daily Return

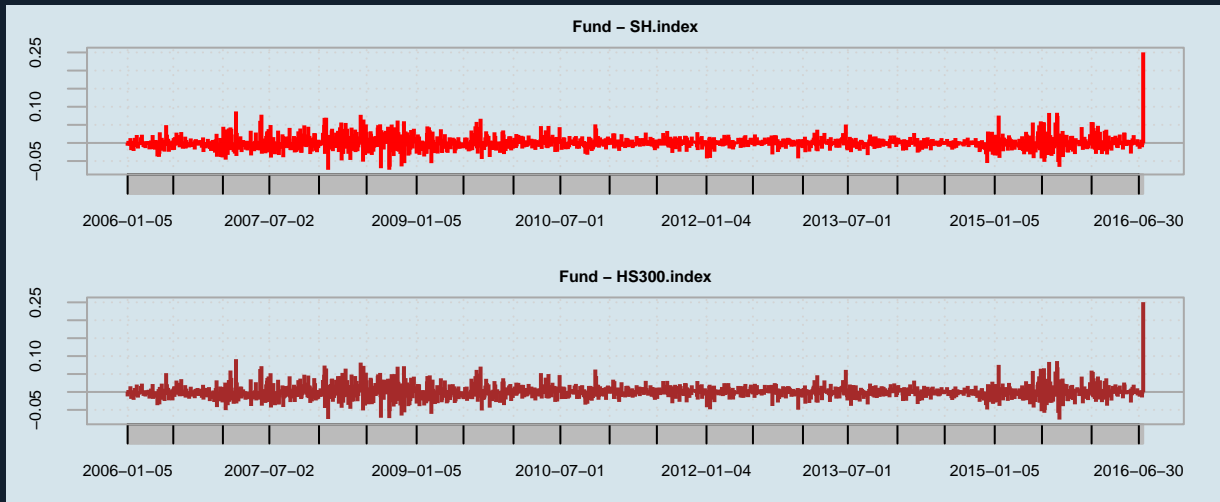


Draw Down



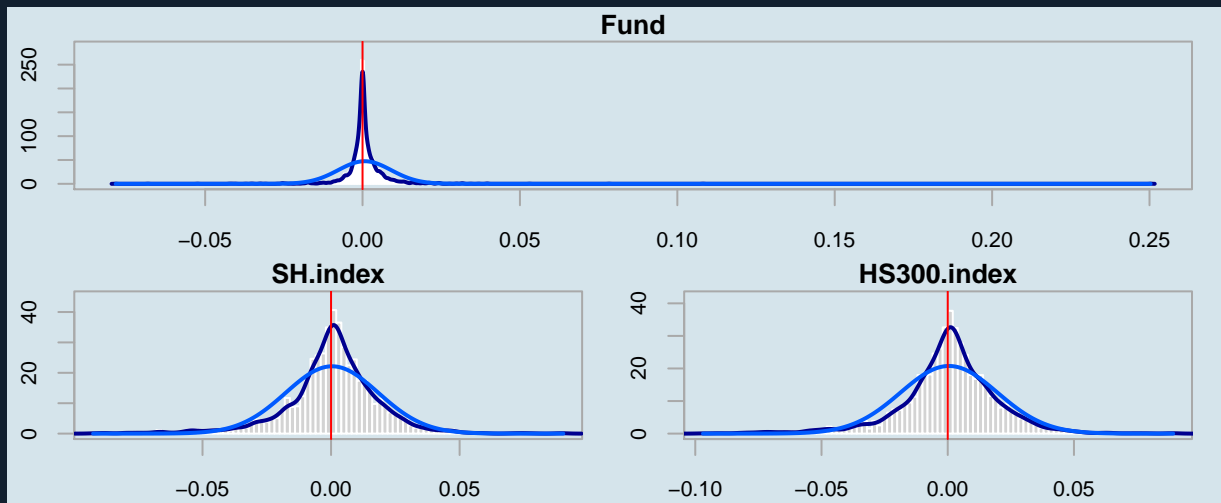
收益波动

单笔最大盈利金额	1,182,055	单笔最大亏损金额	-734,107
单笔最大盈利比例	76.75%	单笔最大亏损比例	-34.50%
最大连续盈利次数	98	最大连续亏损次数	38



相对指数的当日收益率波动

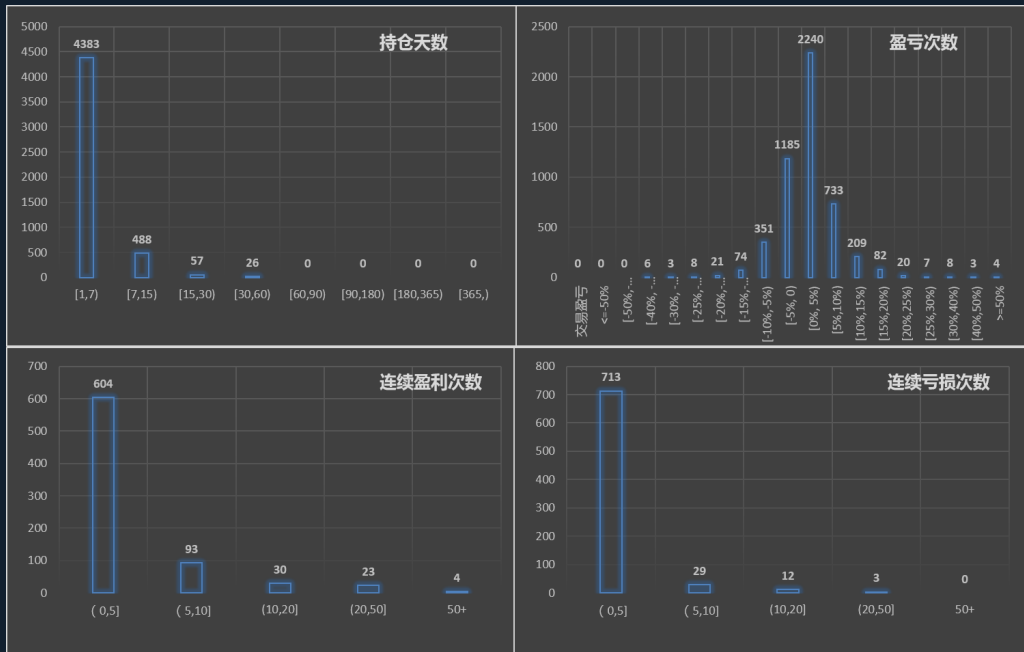
收益分布情况



按年份统计

不同年份的收益情况				
	年份	收益率	最大回撤	收益率/最大回撤
1	2006	20.38%	7.77%	2.62
2	2007	39.95%	3.14%	12.74
3	2008	11.80%	6.59%	1.79
4	2009	27.20%	2.90%	9.39
5	2010	13.15%	7.51%	1.75
6	2011	2.74%	7.60%	0.36
7	2012	14.06%	14.16%	0.99
8	2013	11.57%	3.21%	3.61
9	2014	-2.36%	8.53%	-0.28
10	2015	16.18%	16.84%	0.96
11	2016	45.07%	10.44%	4.32

交易分布统计



分布图