

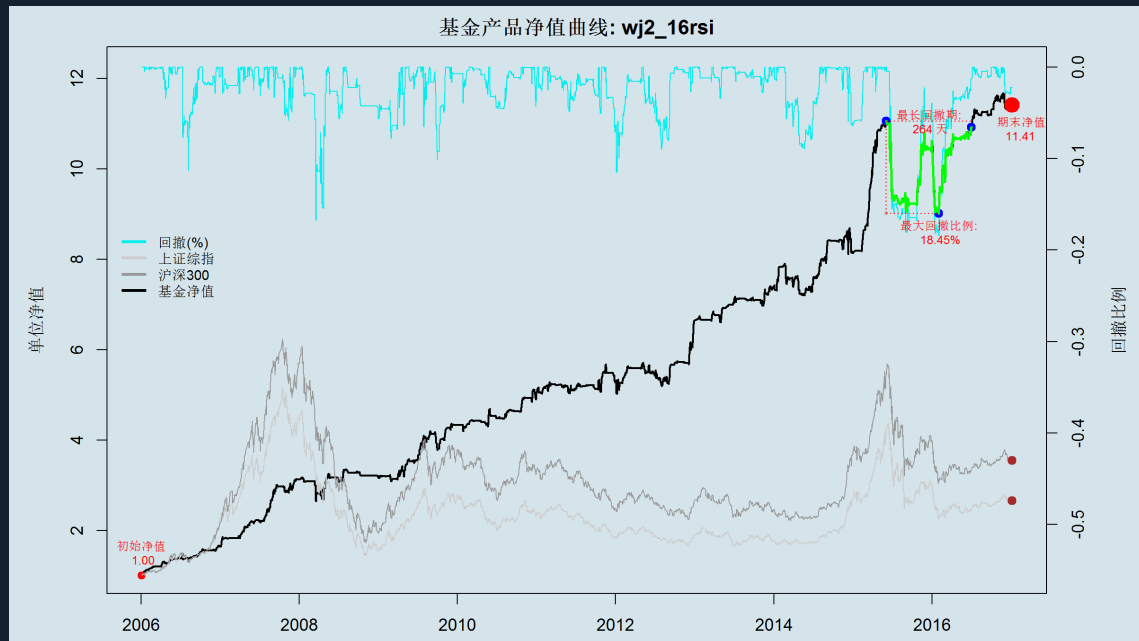
稳健 2_16rsi

回测报告

2017 年 2 月 15 日

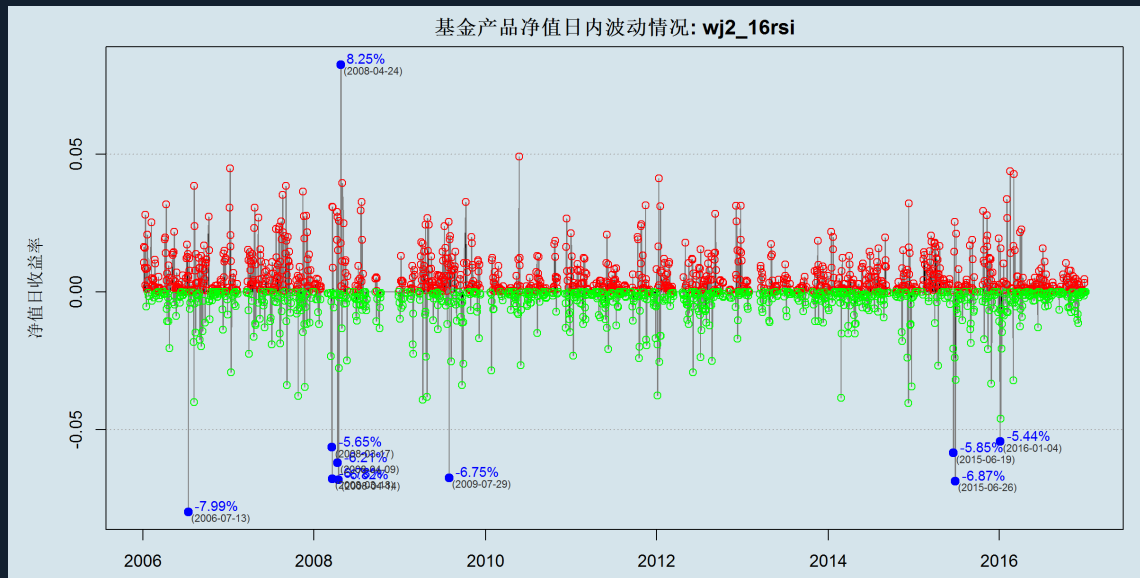


净收益率	年化收益率	胜率	赔率	最大回撤	年化收益/最大回撤	最长回撤期	盈利系数	恢复系数	SR	IR
1041.11%	25.56%	65.28%	0.96	18.45%	1.39	264 天	1.81	5.10	1.82	0.45



交易情况

交易次数	6564	总盈利	1,166,967,799	平均盈利	10,487,852	单笔盈利/ 亏损交易			连续盈利/ 亏损交易	
盈利次数	4285	总亏损	-646,411,058	平均亏损	-16,699,171	最大金额	10,487,852	-16,699,171	最大连续盈利次数	107
胜率	65.28%	盈利系数	1.81	赔率	0.96	最大比例	73.53%	-45.19%	最大连续亏损次数	41

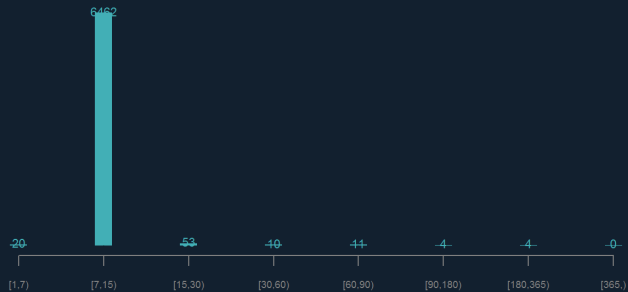


按年份统计

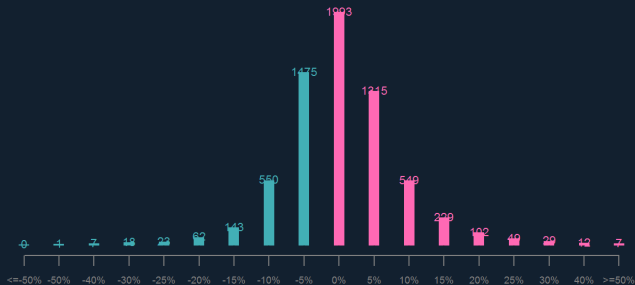
不同年份的收益情况				
	年份	收益率	最大回撤	收益率/最大回撤
1	2006	64.88%	11.32%	5.73
2	2007	89.76%	5.80%	15.48
3	2008	1.08%	16.74%	0.06
4	2009	36.58%	10.15%	3.61
5	2010	16.92%	4.59%	3.68
6	2011	3.59%	7.10%	0.51
7	2012	27.68%	11.51%	2.41
8	2013	11.48%	3.45%	3.33
9	2014	10.57%	8.90%	1.19
10	2015	28.49%	18.05%	1.58
11	2016	14.66%	18.45%	0.79
12	2017	0.00%	2.24%	0.00

交易分布统计

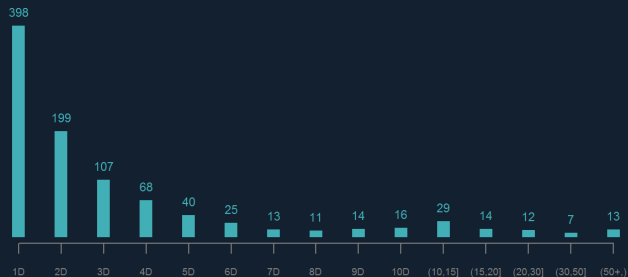
持股周期分布



交易盈亏分布



连续盈利分布



连续亏损分布

