

稳健 2 基础

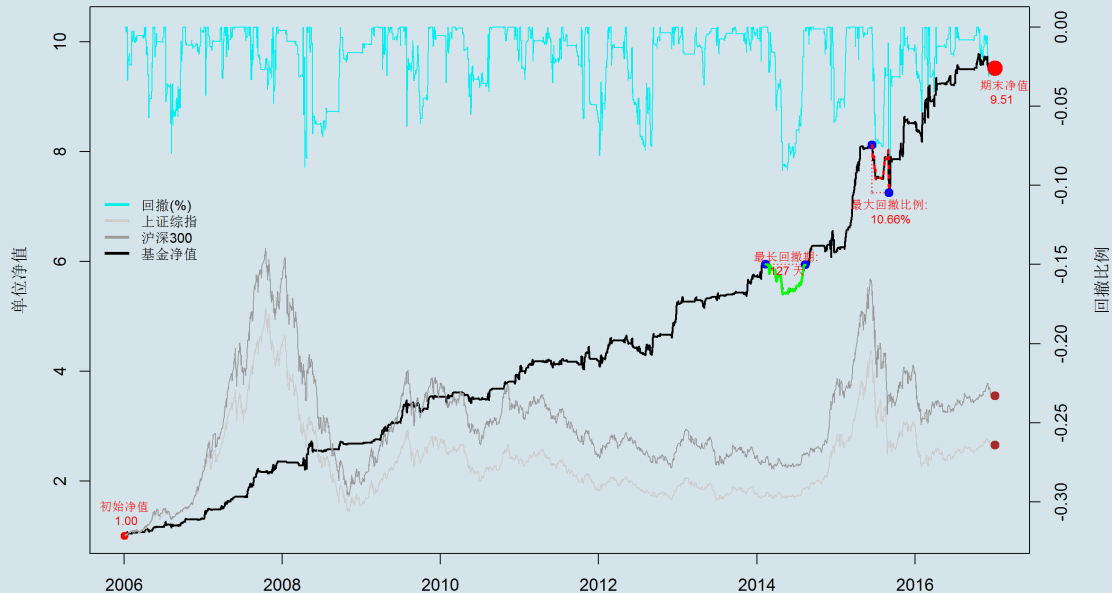
回测报告

2017 年 2 月 15 日



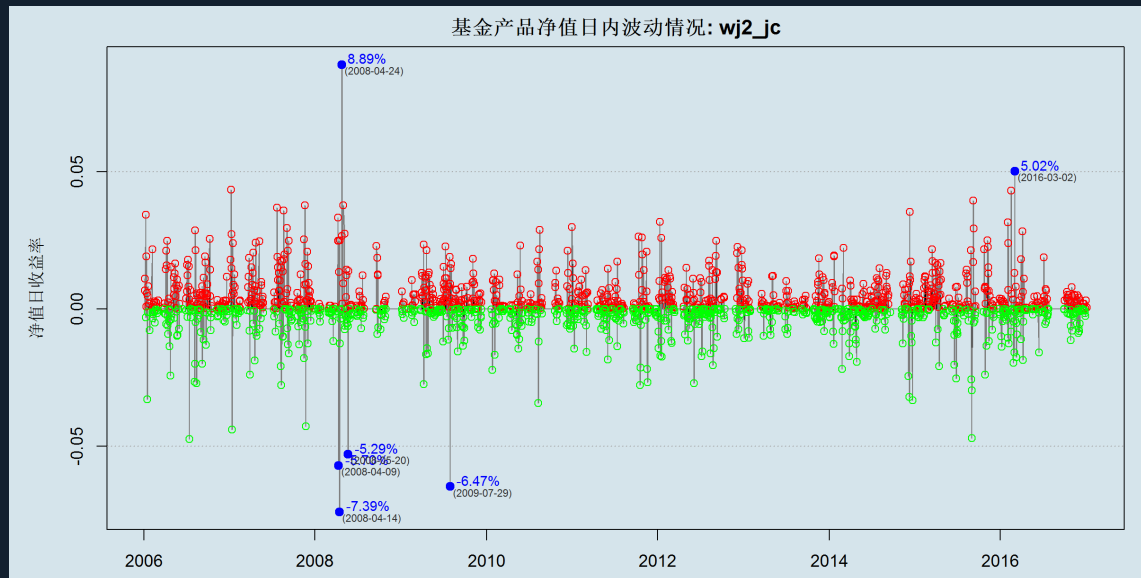
净收益率	年化收益率	胜率	赔率	最大回撤	年化收益/最大回撤	最长回撤期	盈利系数	恢复系数	SR	IR
851.22%	23.44%	64.38%	1.19	10.66%	2.20	127 天	2.15	9.83	1.94	0.36

基金产品净值曲线: wj2_jc



交易情况

交易次数	5433	总盈利	794,302,823	平均盈利	6,542,272	单笔盈利/ 亏损交易			连续盈利/ 亏损交易	
盈利次数	3498	总亏损	-368,694,956	平均亏损	-8,158,625	最大金额	6,542,272	-8,158,625	最大连续盈利次数	121
胜率	64.38%	盈利系数	2.15	赔率	1.19	最大比例	94.46%	-33.89%	最大连续亏损次数	20

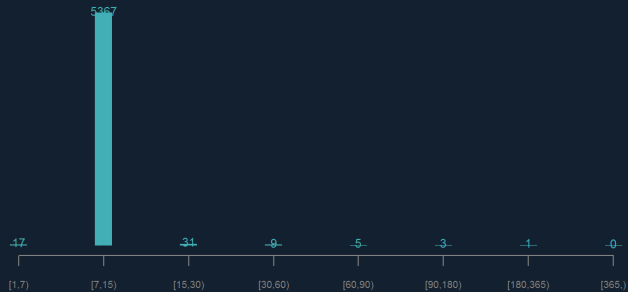


按年份统计

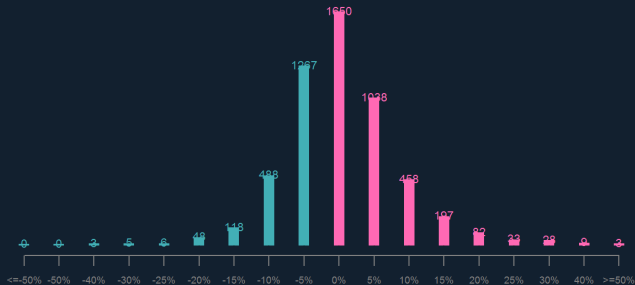
不同年份的收益情况				
	年份	收益率	最大回撤	收益率/最大回撤
1	2006	31.85%	7.96%	4.00
2	2007	78.71%	4.81%	16.37
3	2008	13.85%	8.87%	1.56
4	2009	31.95%	6.26%	5.10
5	2010	12.84%	5.52%	2.33
6	2011	2.91%	6.01%	0.48
7	2012	27.32%	8.11%	3.37
8	2013	10.13%	3.66%	2.77
9	2014	7.96%	9.06%	0.88
10	2015	37.39%	10.66%	3.51
11	2016	12.62%	5.32%	2.37
12	2017	0.00%	2.73%	0.00

交易分布统计

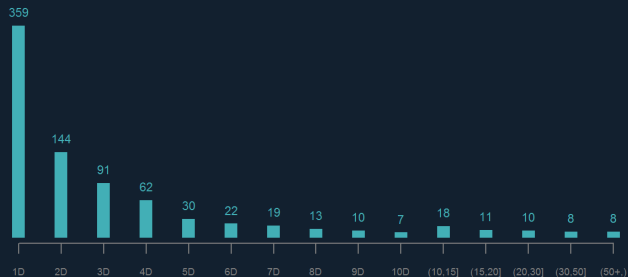
持股周期分布



交易盈亏分布



连续盈利分布



连续亏损分布

