

20170210

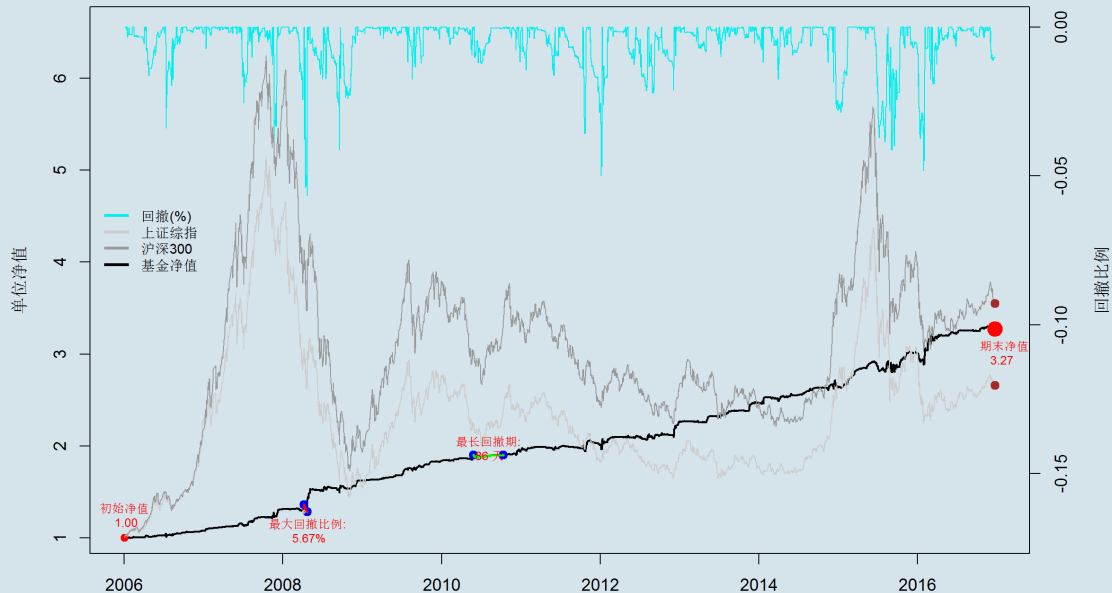
回测报告

2017 年 2 月 13 日



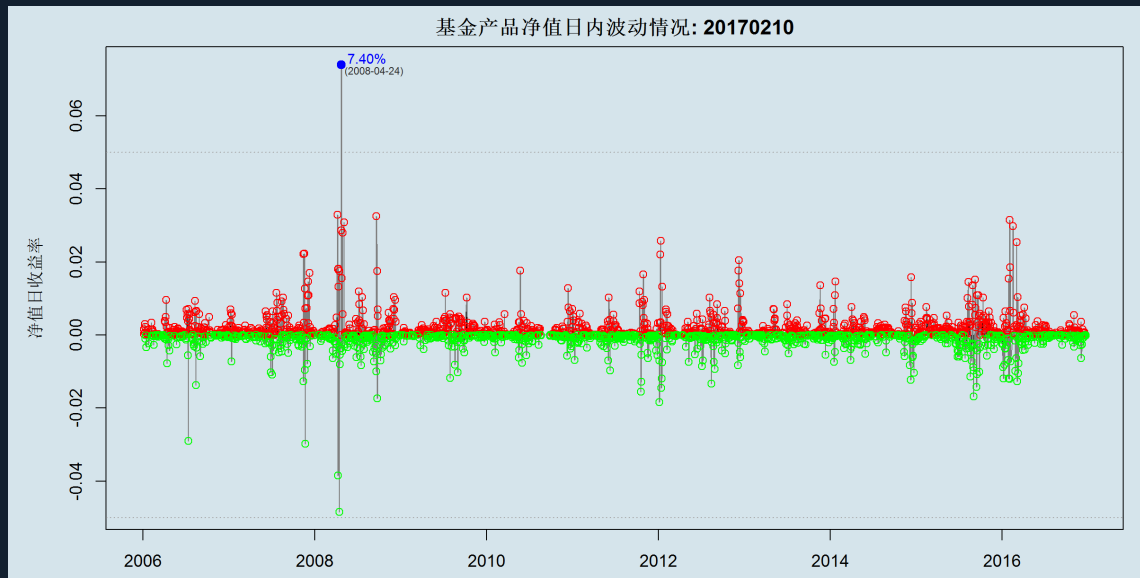
净收益率	年化收益率	胜率	赔率	最大回撤	年化收益/最大回撤	最长回撤期	盈利系数	恢复系数	SR	IR
226.95%	11.75%	67.56%	1.20	5.67%	2.07	86 天	2.51	15.54	1.80	-0.03

基金产品净值曲线: 20170210



交易情况

交易次数	9847	总盈利	2,264,651,090	平均盈利	10,384,680	单笔盈利/ 亏损交易			连续盈利/ 亏损交易	
盈利次数	6653	总亏损	-902,940,735	平均亏损	-10,422,865	最大金额	10,384,680	-10,422,865	最大连续盈利次数	329
胜率	67.56%	盈利系数	2.51	赔率	1.20	最大比例	288.33%	-47.09%	最大连续亏损次数	28

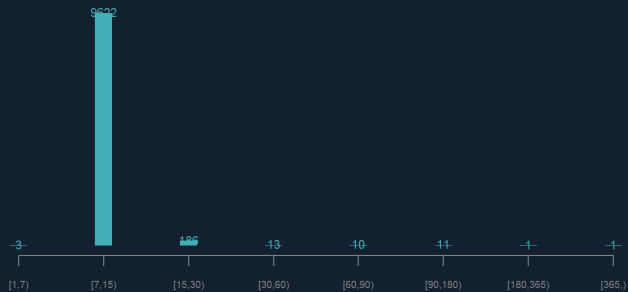


按年份统计

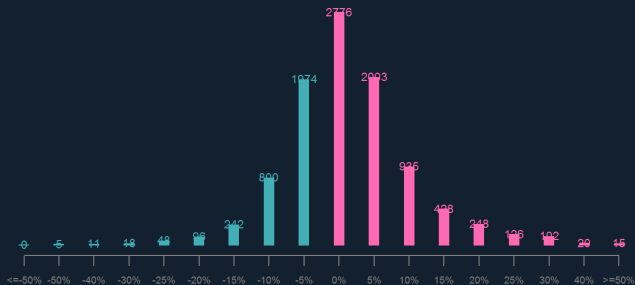
不同年份的收益情况				
	年份	收益率	最大回撤	收益率/最大回撤
1	2006	7.75%	3.40%	2.28
2	2007	22.06%	3.85%	5.73
3	2008	23.51%	5.67%	4.15
4	2009	13.38%	1.75%	7.64
5	2010	6.30%	1.23%	5.14
6	2011	2.27%	3.58%	0.63
7	2012	13.33%	5.00%	2.67
8	2013	9.08%	0.99%	9.20
9	2014	6.98%	2.81%	2.49
10	2015	13.85%	4.13%	3.36
11	2016	9.80%	4.82%	2.03

交易分布统计

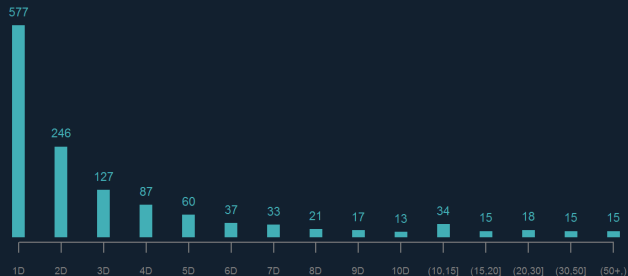
持股周期分布



交易盈亏分布



连续盈利分布



连续亏损分布

