

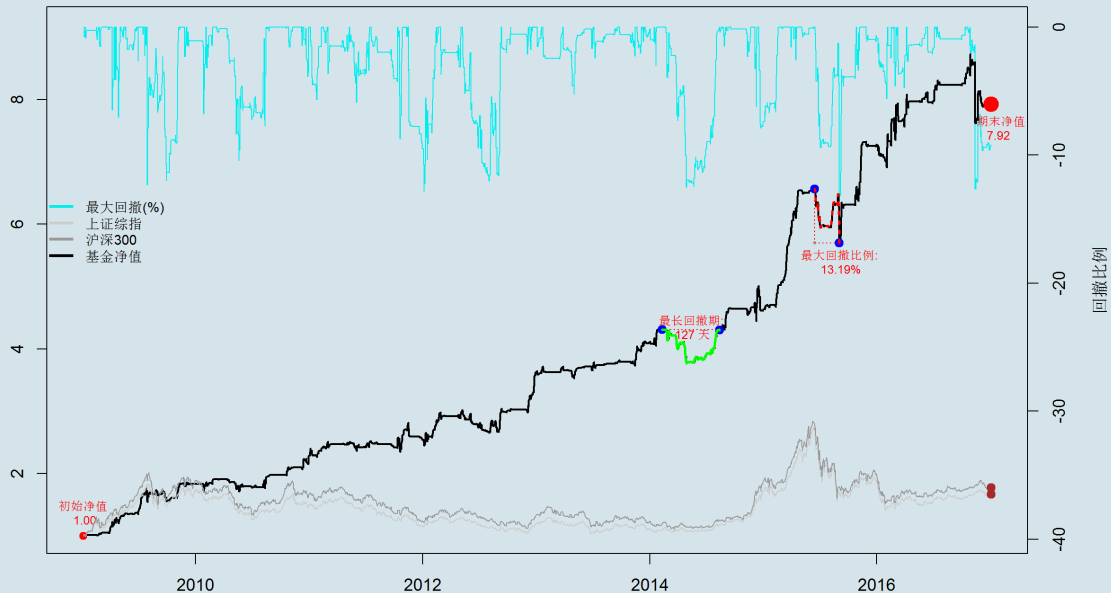
汉云量化选股模型

回测报告

2017 年 3 月 14 日

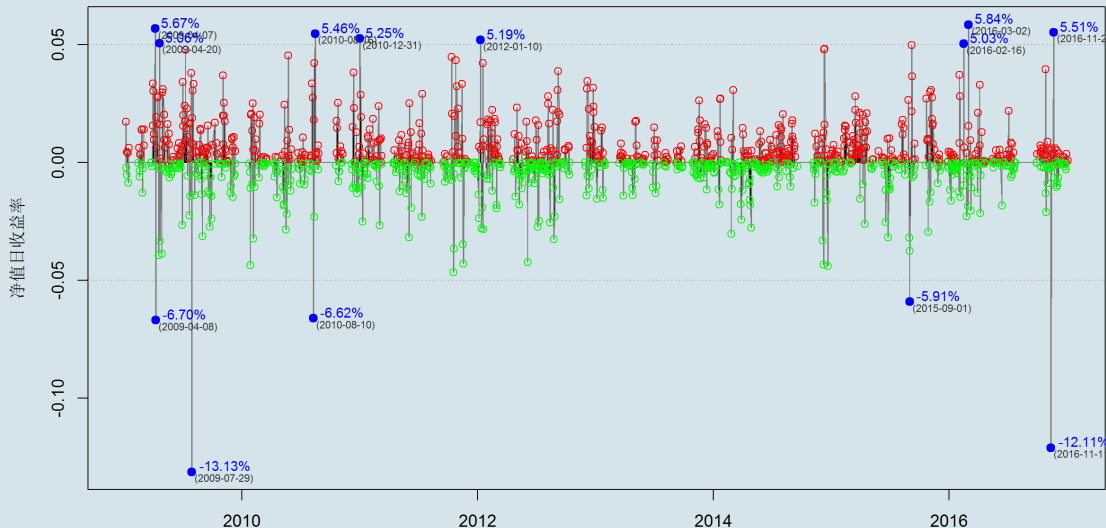


净收益率	年化收益率	胜率	赔率	最大回撤	年化收益/最大回撤	最长回撤期	盈利系数	恢复系数	SR	IR
692.22%	30.48%	62.82%	1.21	13.19%	2.31	127 天	2.04	6.26	1.73	0.86



交易情况

交易次数	4072	总盈利	667,867,776	平均盈利	6,542,064	单笔盈利/ 亏损交易			连续盈利/ 亏损交易	
盈利次数	2558	总亏损	-327,650,162	平均亏损	-8,158,536	最大金额	6,542,064	-8,158,536	最大连续盈利次数	99
胜率	62.82%	盈利系数	2.04	赔率	1.21	最大比例	49.06%	-33.89%	最大连续亏损次数	20

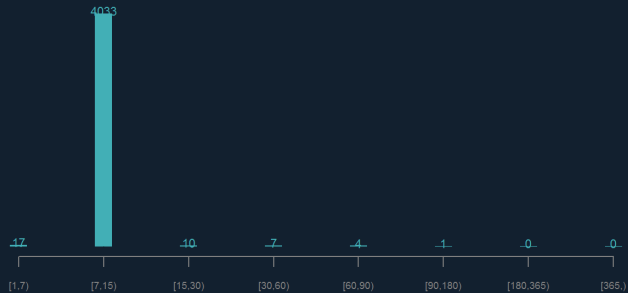


按年份统计

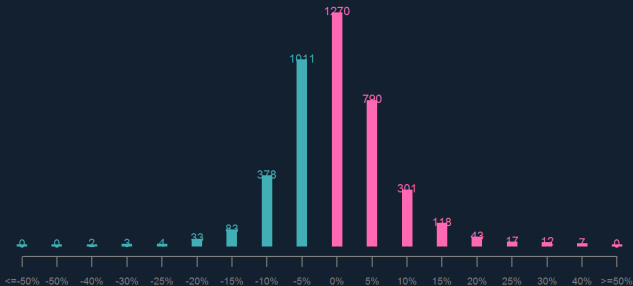
不同年份的收益情况				
	年份	收益率	最大回撤	收益率/最大回撤
1	2009	83.56%	12.31%	6.79
2	2010	24.77%	10.43%	2.37
3	2011	7.99%	9.51%	0.84
4	2012	45.13%	12.83%	3.52
5	2013	14.75%	5.27%	2.80
6	2014	13.13%	12.50%	1.05
7	2015	56.08%	13.19%	4.25
8	2016	10.32%	12.67%	0.81

交易分布统计

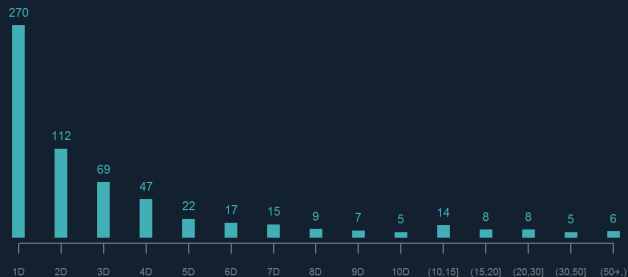
持股周期分布



交易盈亏分布



连续盈利分布



连续亏损分布

