

YDP_all 高点回落平仓策略

回测报告

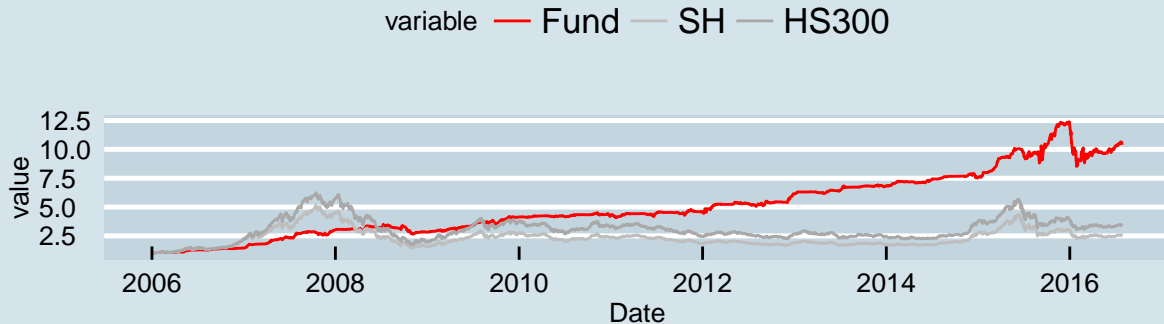
2016 年 9 月 20 日



基金净值

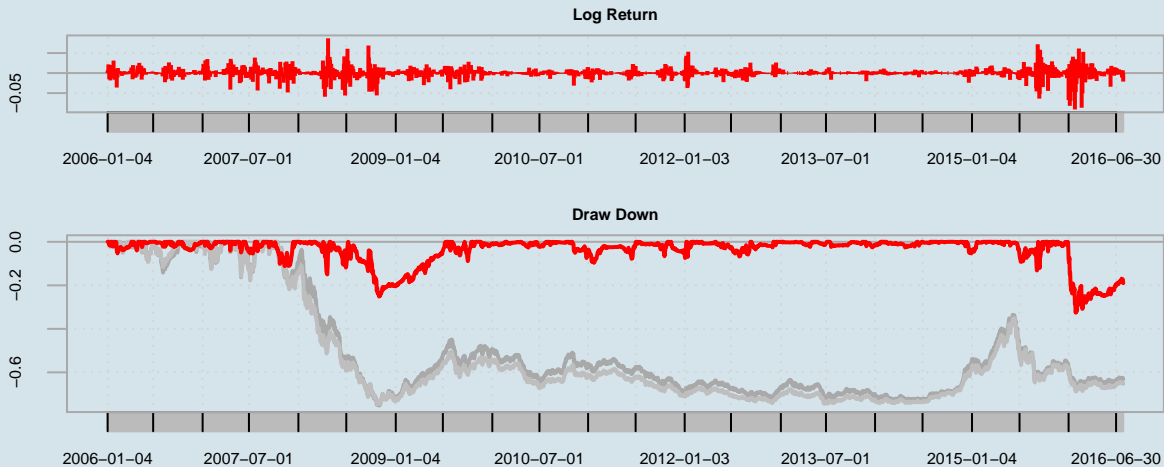
项目	回测开始	回测结束
日期	2006-01-04	2016-07-27
资金规模	50,000,000	519,552,002
总收益	939.10%	
年化收益	24.80%	

Net Value



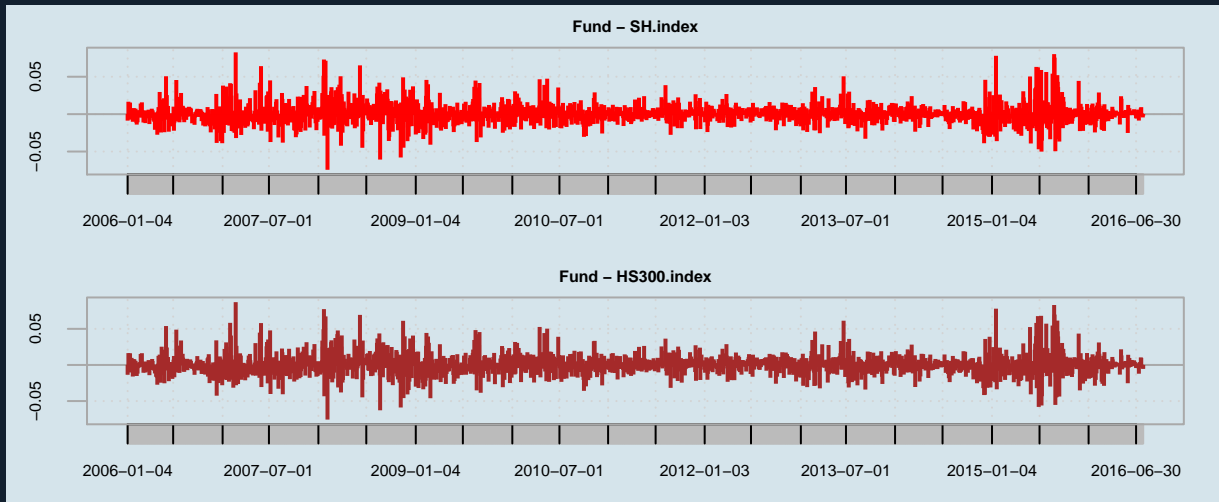
交易情况

交易次数	5195	盈利总额	911,202,557	单笔平均盈利	265,192	最大回撤额	193,831,287
盈利次数	3436	亏损总额	-471,813,886	单笔平均亏损	-268,228	最大回撤比	31.29%
胜率	66.14%	盈利比	1.93	赔率	0.99	年化收益/最大回撤比	0.79



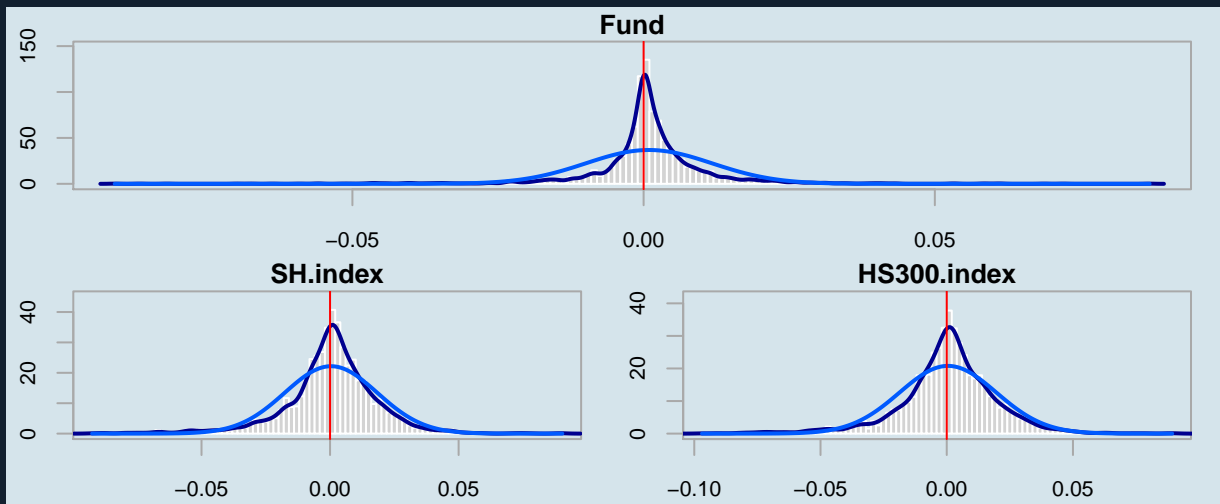
收益波动

单笔最大盈利金额	19,600,511	单笔最大亏损金额	-9,872,654
单笔最大盈利比例	957.12%	单笔最大亏损比例	-88.16%
最大连续盈利次数	45	最大连续亏损次数	24



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	44.64%	5.25%	8.51
2	2007	107.44%	10.95%	9.81
3	2008	-7.02%	24.18%	-0.29
4	2009	45.83%	19.01%	2.41
5	2010	3.43%	7.35%	0.47
6	2011	6.33%	9.44%	0.67
7	2012	35.47%	7.38%	4.80
8	2013	10.90%	2.54%	4.29
9	2014	10.53%	5.28%	1.99
10	2015	60.81%	12.73%	4.78
11	2016	-9.16%	31.29%	-0.29

交易分布统计

