

# 量化策略模型

---

## 回测报告

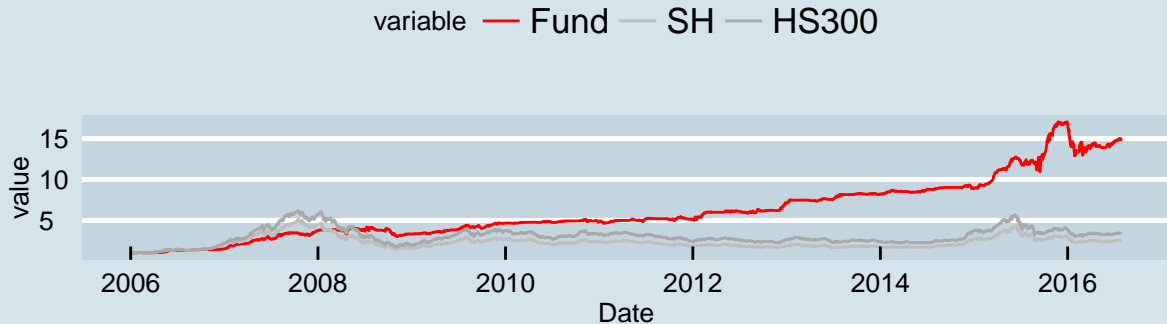
2016 年 9 月 12 日



# 基金净值

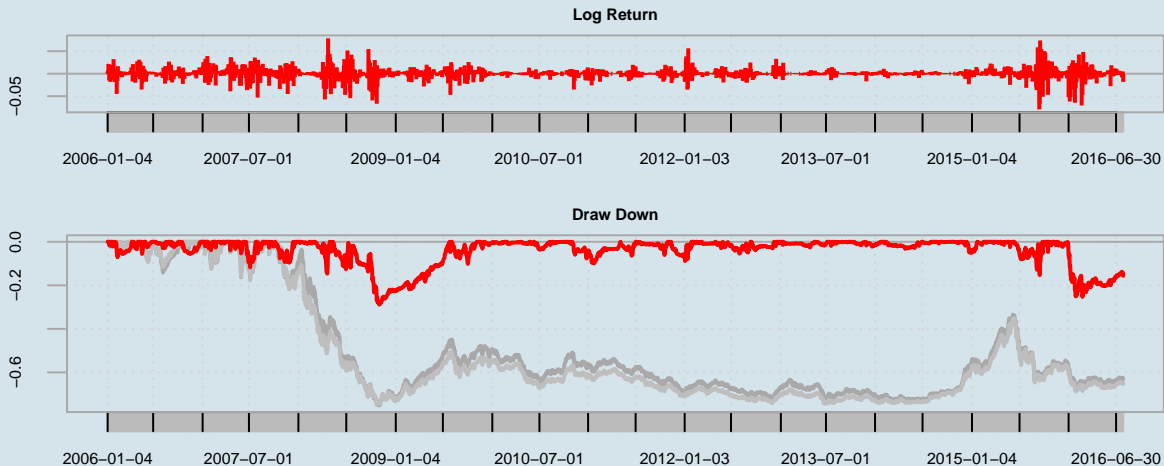
项目	回测开始	回测结束
日期	2006-01-04	2016-07-27
资金规模	50,000,000	735,414,692
总收益	1370.83%	
年化收益	28.97%	

## Net Value



# 交易情况

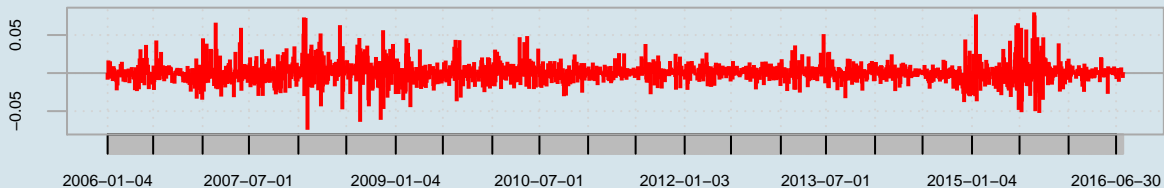
交易次数	5239	盈利总额	1,163,768,569	单笔平均盈利	366,656	最大回撤额	207,050,340
盈利次数	3174	亏损总额	-507,713,024	单笔平均亏损	-245,865	最大回撤比	27.27%
胜率	60.58%	盈利比	2.29	赔率	1.49	年化收益/最大回撤比	1.06



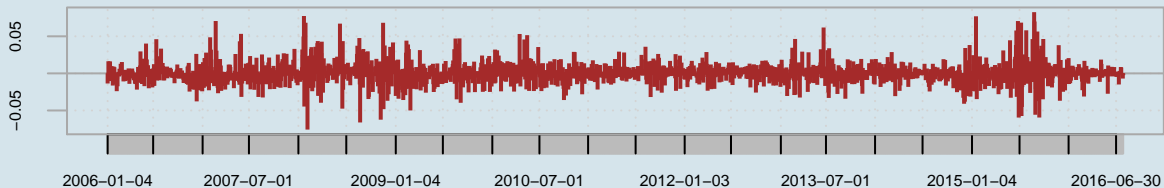
# 收益波动

单笔最大盈利金额	23,237,331	单笔最大亏损金额	-9,872,654
单笔最大盈利比例	1010.09%	单笔最大亏损比例	-87.22%
最大连续盈利次数	38	最大连续亏损次数	29

Fund - SH.index

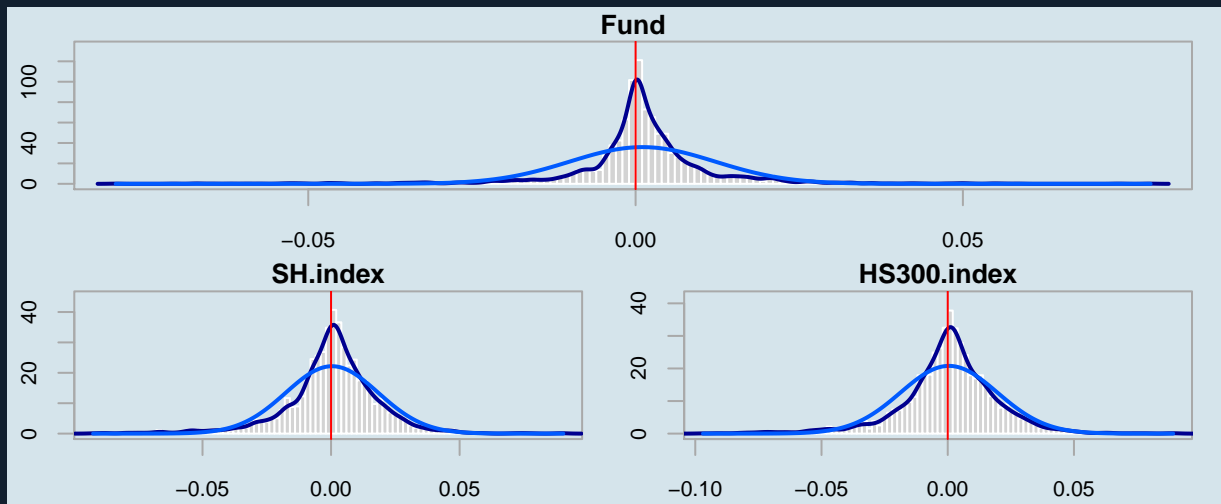


Fund - HS300.index



相对指数的当日收益率波动

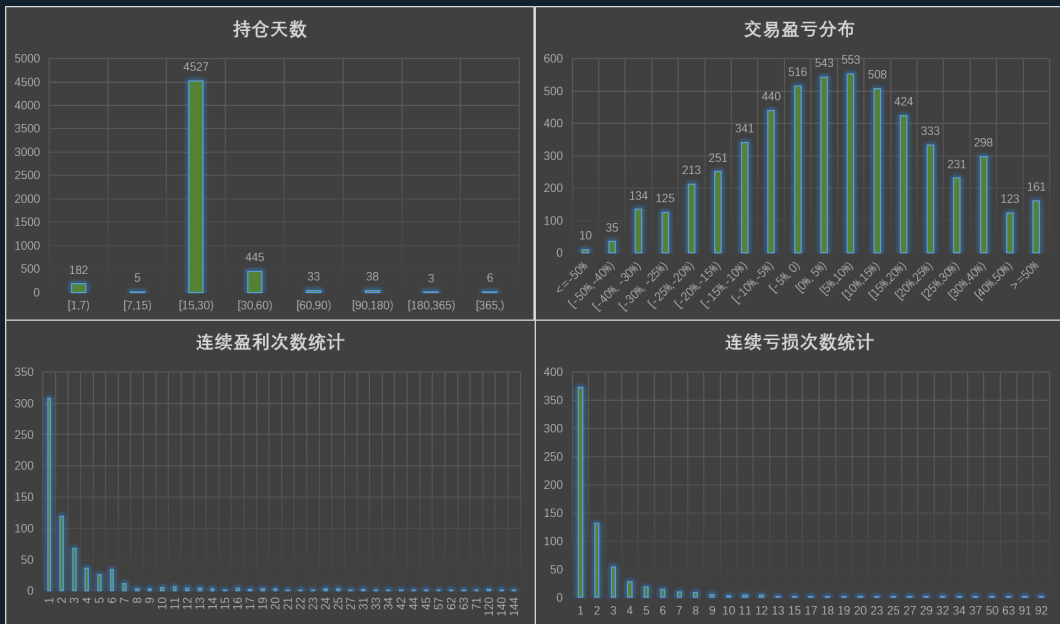
# 收益分布情况



# 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	52.71%	6.94%	7.59
2	2007	142.56%	11.50%	12.40
3	2008	-11.77%	27.27%	-0.43
4	2009	39.84%	20.65%	1.93
5	2010	4.28%	7.52%	0.57
6	2011	4.93%	9.73%	0.51
7	2012	39.89%	8.75%	4.56
8	2013	15.16%	2.57%	5.89
9	2014	8.32%	5.05%	1.65
10	2015	88.16%	14.21%	6.20
11	2016	-8.18%	24.27%	-0.34

# 交易分布统计



YDP 基金产品组合