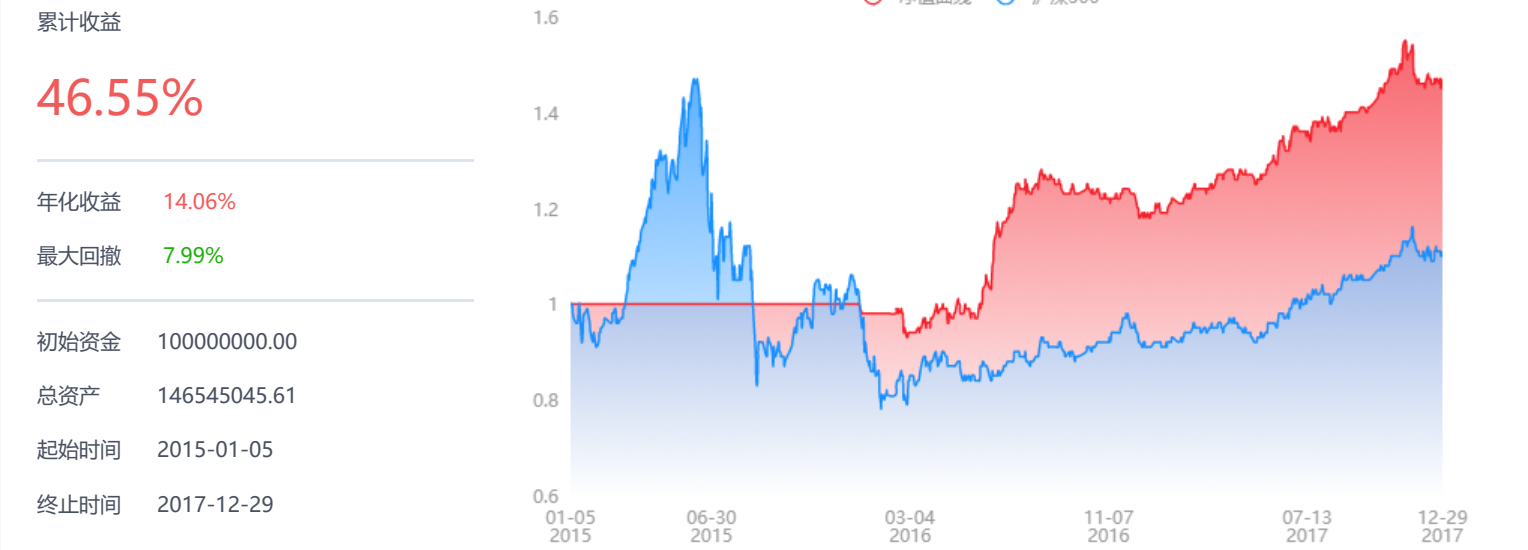


业绩走势



策略详情

| 策略信息 |        |        |      |      |      |      |       |         |                       |
|------|--------|--------|------|------|------|------|-------|---------|-----------------------|
| 策略名称 | 年化收益率  | 基准收益率  | 阿尔法  | 贝塔   | 夏普比率 | 信息比率 | 最大回撤  | 换手率     | 回测时间                  |
| RSI  | 14.06% | 10.69% | 0.11 | 0.12 | 1.18 | 0.38 | 7.99% | 382.97% | 2015-01-05~2017-12-29 |

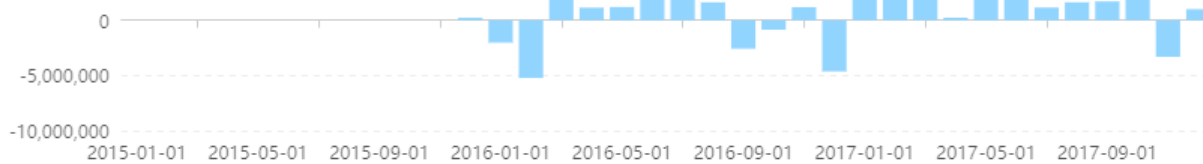
周期分析

| 月周期分析   |      |       |      |      |      |       |
|---------|------|-------|------|------|------|-------|
| 月份      | 净利   | 净利率   | 毛利   | 毛损   | 交易次数 | 胜率    |
| 2015-01 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-02 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-03 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-04 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-05 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-06 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-07 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-08 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-09 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-10 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |
| 2015-11 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0    | 0.00% |

|         |             |        |             |             |    |        |
|---------|-------------|--------|-------------|-------------|----|--------|
| 2015-12 | 218253.44   | 0.22%  | 732801.34   | 514547.90   | 0  | 0.00%  |
| 2016-01 | -2028138.82 | -2.02% | 0.00        | 2028138.82  | 4  | 0.00%  |
| 2016-02 | -5227148.30 | -5.32% | 3972287.72  | 9199436.02  | 15 | 0.00%  |
| 2016-03 | 3841072.60  | 4.13%  | 14044902.76 | 10203830.16 | 11 | 27.27% |
| 2016-04 | 1138883.35  | 1.18%  | 14713482.36 | 13574599.01 | 13 | 38.46% |
| 2016-05 | 1195767.52  | 1.22%  | 16100480.99 | 14904713.48 | 9  | 44.44% |
| 2016-06 | 17603456.51 | 17.76% | 29690414.50 | 12086957.99 | 15 | 73.33% |
| 2016-07 | 7505503.20  | 6.43%  | 21321176.59 | 13815673.39 | 14 | 71.43% |
| 2016-08 | 1616860.84  | 1.30%  | 16383405.34 | 14766544.50 | 12 | 66.67% |
| 2016-09 | -2579158.60 | -2.05% | 9738114.15  | 12317272.75 | 17 | 64.71% |
| 2016-10 | -866127.24  | -0.70% | 7535378.53  | 8401505.78  | 3  | 0.00%  |
| 2016-11 | 1178822.97  | 0.96%  | 11948180.99 | 10769358.02 | 15 | 26.67% |
| 2016-12 | -4640850.73 | -3.75% | 9368969.54  | 14009820.28 | 27 | 40.74% |
| 2017-01 | 3041860.08  | 2.56%  | 11787868.66 | 8746008.58  | 12 | 33.33% |
| 2017-02 | 2120261.83  | 1.74%  | 10985915.56 | 8865653.73  | 4  | 50.00% |
| 2017-03 | 2500057.26  | 2.01%  | 15261310.00 | 12761252.74 | 16 | 43.75% |
| 2017-04 | 225563.49   | 0.18%  | 13980939.96 | 13755376.48 | 25 | 48.00% |
| 2017-05 | 2936150.33  | 2.31%  | 14392904.44 | 11456754.10 | 18 | 44.44% |
| 2017-06 | 7235502.97  | 5.58%  | 21044464.20 | 13808961.23 | 8  | 87.50% |
| 2017-07 | 1151561.43  | 0.84%  | 16999202.21 | 15847640.78 | 15 | 53.33% |
| 2017-08 | 1621072.37  | 1.17%  | 19347511.30 | 17726438.93 | 14 | 71.43% |
| 2017-09 | 1703961.08  | 1.22%  | 16879885.79 | 15175924.71 | 21 | 52.38% |
| 2017-10 | 7374123.90  | 5.21%  | 20860279.59 | 13486155.69 | 22 | 59.09% |
| 2017-11 | -3320011.59 | -2.23% | 23722984.13 | 27042995.71 | 43 | 53.49% |
| 2017-12 | 997745.72   | 0.69%  | 12086499.62 | 11088753.90 | 50 | 52.00% |

月盈利



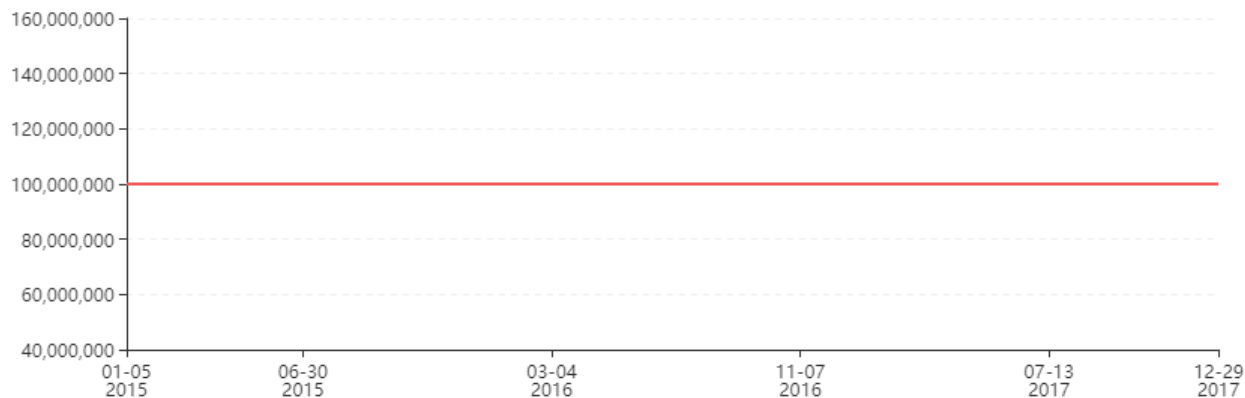


## 策略分析

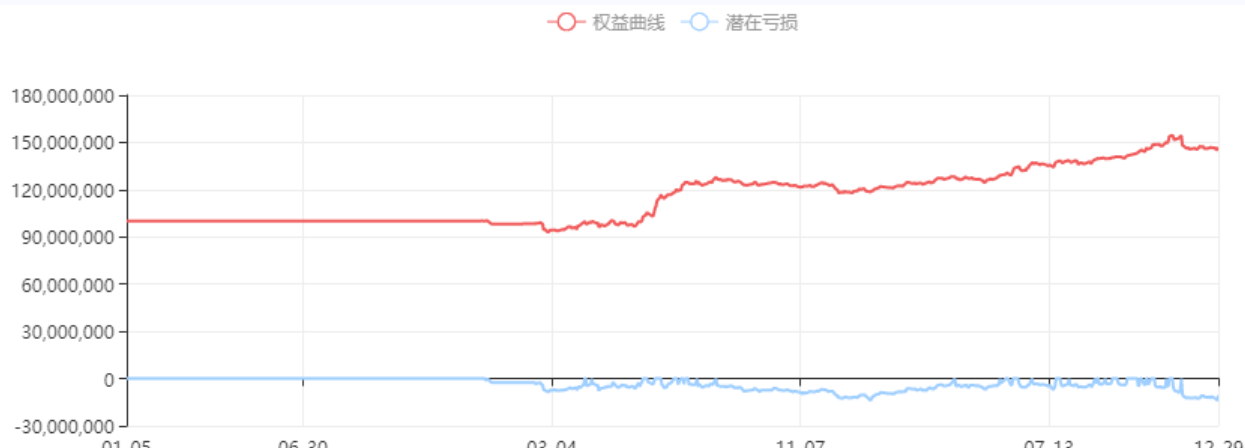
多头权益曲线



空头权益曲线



权益曲线及潜在亏损



策略绩效概要

|         |              |         |             |
|---------|--------------|---------|-------------|
| 初始资金    | 100000000.00 | 算术年化收益率 | 16.02%      |
| 初始资金收益率 | 46.55%       | 几何年化收益率 | 14.06%      |
| 净利      | 46545045.61  | 最大回撤    | 10235619.46 |
| 毛利      | 91189425.47  | 最大回撤率   | 7.99%       |
| 毛损      | -44644379.85 | 已付手续费   | 2173716.53  |
| 盈利因子    | 2.04         | 已付滑价    | 0.00        |
| 多头净利    | 46545045.61  | 标的个数    | 175         |
| 空头净利    | 0.00         |         |             |

绩效比率

|      |          |           |           |        |
|------|----------|-----------|-----------|--------|
| 夏普比率 | Calmar比率 | Sortino比率 | 净利/最大潜在亏损 | 手续费/净利 |
| 1.18 | 1.51     | 1.78      | 0.00      | 0.05   |

时间分析

|      |        |                         |           |
|------|--------|-------------------------|-----------|
| 策略天数 | 平均持仓时间 | 策略最大回撤期                 | 策略最大不盈利天数 |
| 732  | 53.50  | 2016-08-15 ~ 2016-12-29 | 153.0     |

交易分析

连续交易分析

|          |          |             |             |
|----------|----------|-------------|-------------|
| 最大连续盈利天数 | 最大连续亏损天数 | 最大日连续盈利额    | 最大日连续亏损额    |
| 8        | 239      | 13813355.68 | -7761874.35 |

总体交易分析

|       |          |        |        |        |           |            |           |            |
|-------|----------|--------|--------|--------|-----------|------------|-----------|------------|
| 交易总数量 | 未平仓交易总数量 | 盈利交易次数 | 亏损交易次数 | 胜率     | 平均盈利额     | 平均亏损额      | 平均盈利/平均亏损 | 资金周转周期 (天) |
| 403   | 38       | 198    | 205    | 49.13% | 460552.65 | -217777.46 | 2.11      | 65.80      |