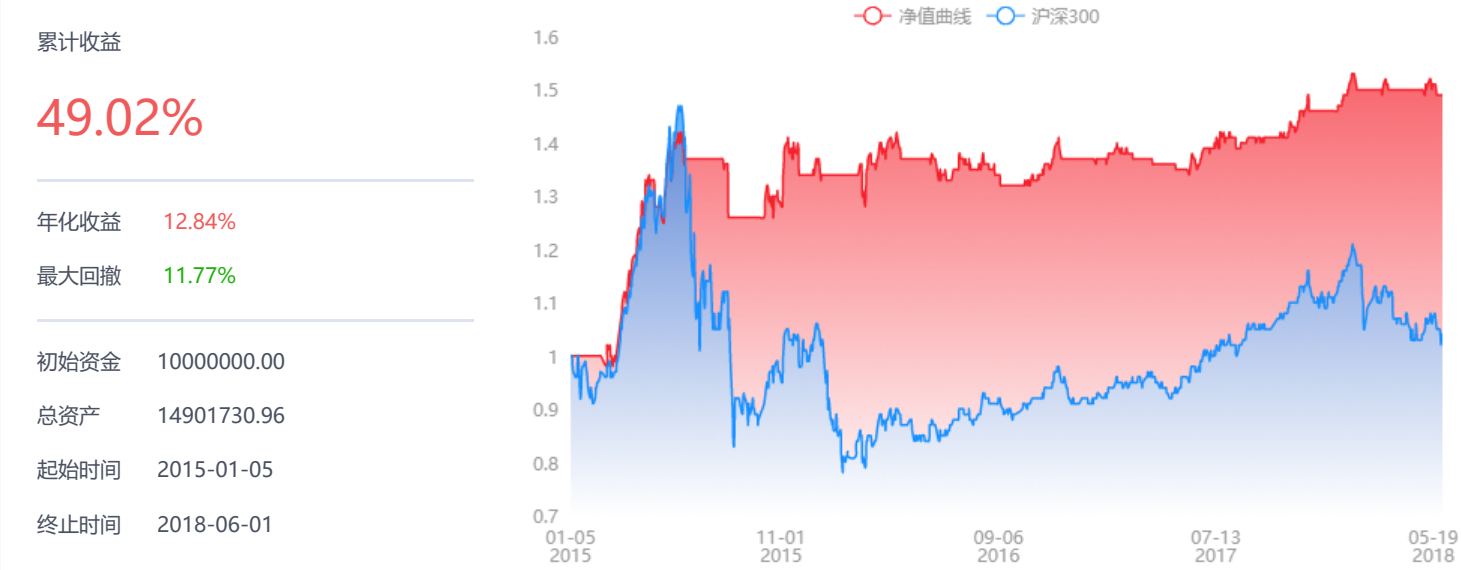


# test\_qianhai\_renshou

## 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
test_qianhai_renshou	12.84%	3.54%	0.10	0.26	0.82	0.50	11.77%	104.06%	2015-01-05~2018-06-01

## 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	109389.70	1.09%	372600.00	263210.30	0	0.00%
2015-03	1211220.00	11.98%	2068740.00	857520.00	0	0.00%
2015-04	1989360.00	17.57%	2812860.00	823500.00	0	0.00%
2015-05	-42292.29	-0.32%	1693204.65	1735496.93	1	100.00%
2015-06	444941.97	3.35%	1450841.97	1005900.00	1	100.00%
2015-07	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2015-08	-1065081.53	-7.77%	117120.00	1182201.53	1	0.00%
2015-09	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
2015-10	302166.13	2.39%	1353600.00	1051433.87	0	0.00%
2015-11	434748.40	3.36%	1903200.00	1468451.60	1	100.00%

	2015-12	47093.23	0.35%	653333.23	606240.00	1	100.00%
	2016-01	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
	2016-02	-619316.24	-4.61%	385203.76	1004520.00	0	0.00%
	2016-03	1126818.77	8.79%	1784160.00	657341.23	1	100.00%
	2016-04	-243224.39	-1.74%	415800.00	659024.39	1	100.00%
	2016-05	25572.71	0.19%	25572.71	0.00	0	0.00%
	2016-06	-397641.21	-2.90%	585600.00	983241.21	1	0.00%
	2016-07	211800.00	1.59%	878400.00	666600.00	0	0.00%
	2016-08	16467.89	0.12%	444367.60	427899.71	2	100.00%
	2016-09	-327112.25	-2.41%	3600.00	330712.25	2	0.00%
	2016-10	83162.66	0.63%	372000.00	288837.34	0	0.00%
	2016-11	651600.00	4.90%	1005000.00	353400.00	0	0.00%
	2016-12	-230049.49	-1.65%	101400.00	331449.49	1	100.00%
	2017-01	-11991.21	-0.09%	74302.47	86293.67	1	0.00%
	2017-02	139860.00	1.02%	466020.00	326160.00	0	0.00%
	2017-03	-174008.00	-1.26%	90180.00	264188.00	2	50.00%
	2017-04	-100353.18	-0.73%	61020.00	161373.18	1	0.00%
	2017-05	-88687.34	-0.65%	60572.22	149259.56	1	0.00%
	2017-06	433620.00	3.21%	892620.00	459000.00	0	0.00%
	2017-07	214920.00	1.54%	812700.00	597780.00	0	0.00%
	2017-08	-79177.72	-0.56%	398700.13	477877.85	2	100.00%
	2017-09	-5500.92	-0.04%	243360.00	248860.92	1	100.00%
	2017-10	237855.42	1.69%	441120.00	203264.58	0	0.00%
	2017-11	309362.25	2.16%	824160.00	514797.75	1	100.00%
	2017-12	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
	2018-01	426715.52	2.92%	813832.62	387117.10	1	100.00%
	2018-02	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
	2018-03	-58066.61	-0.39%	289920.00	347986.61	1	0.00%
	2018-04	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%
	2018-05	-72441.33	-0.48%	438720.00	511161.33	1	0.00%
	2018-06	0.00	0.00%	0.00	0.00	0	0.00%

## 月盈利

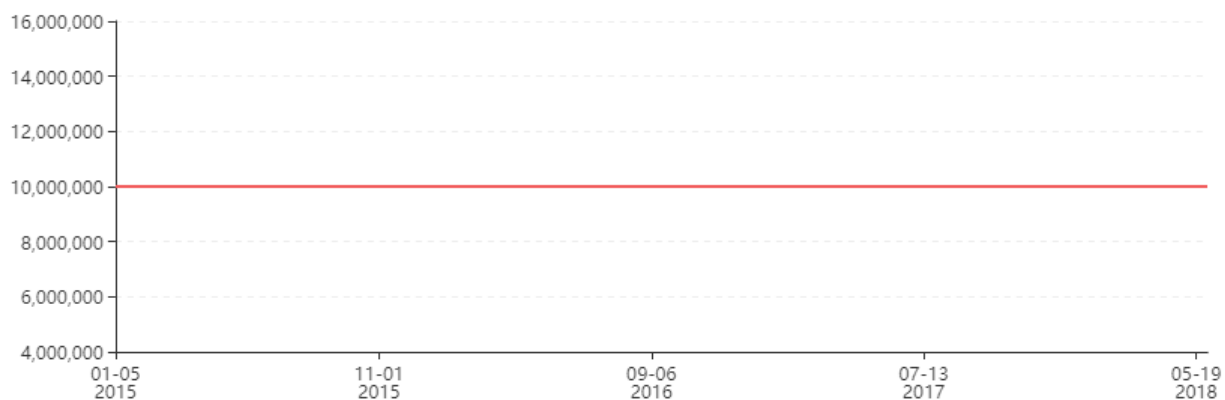


## 策略分析

### 多头权益曲线



### 空头权益曲线



## 权益曲线及潜在亏损

—○— 权益曲线 —○— 潜在亏损



## 策略绩效概要

初始资金	10000000.00	算术年化收益率	14.85%
初始资金收益率	49.02%	几何年化收益率	12.84%
净利	4901730.96	最大回撤	1675833.43
毛利	7151630.14	最大回撤率	11.77%
毛损	-2249899.18	已付手续费	11549.04
盈利因子	3.18	已付滑价	0.00
多头净利	4901730.96	标的个数	1
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
0.82	0.92	1.23	0.00	0.00

## 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
832	26.28	2015-06-12 ~ 2015-10-08	578.0

## 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
32	33	1581720.00	-1070481.83

### 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）
25	0	15	10	60.00%	476775.34	-224989.92	2.12	242.17