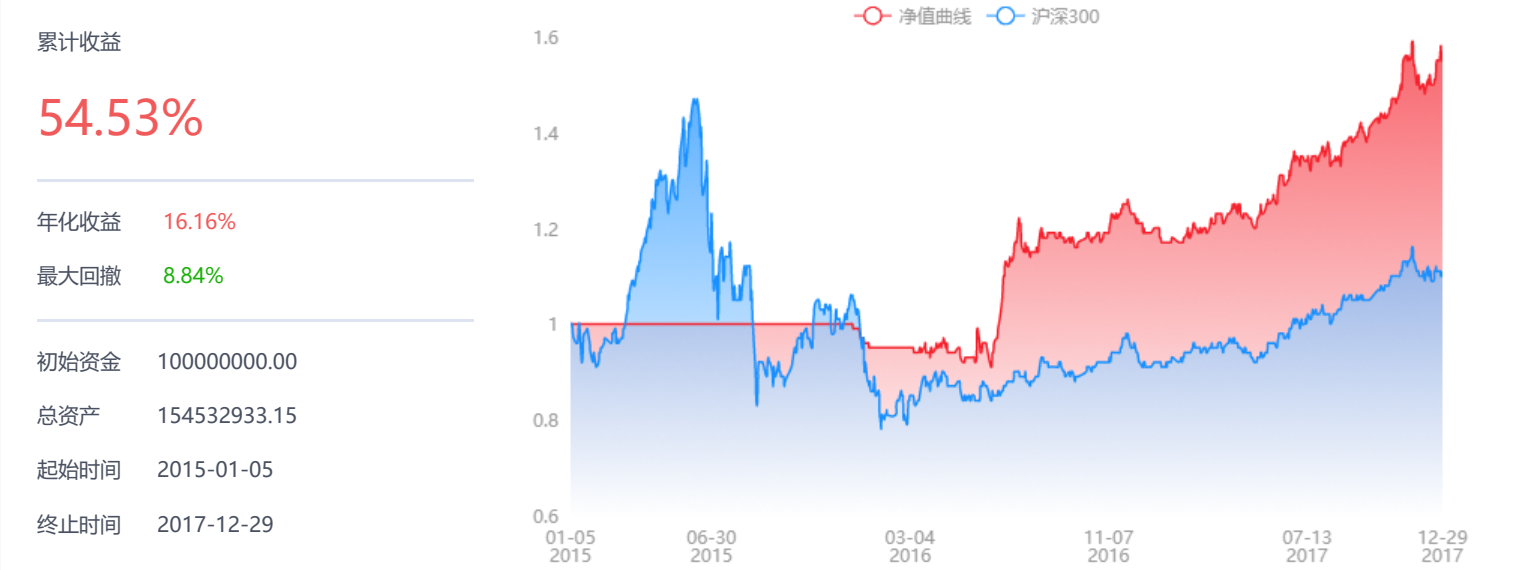


业绩走势



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
BollTrading2p	16.16%	10.69%	0.13	0.11	1.17	0.45	8.84%	539.89%	2015-01-05~2017-12-29

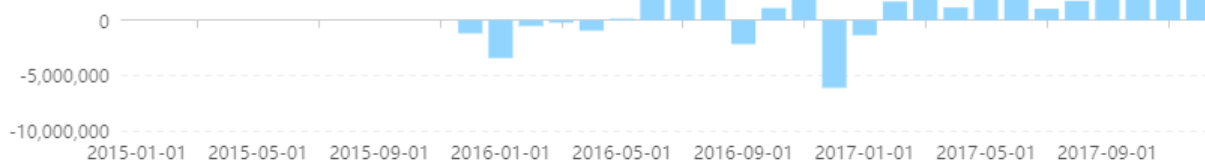
周期分析

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	-1191349.41	-1.19%	3065580.74	4256930.15	8	12.50%
2016-01	-3418925.32	-3.46%	1459249.52	4878174.84	11	0.00%
2016-02	-519597.00	-0.54%	234646.92	754243.92	1	0.00%
2016-03	-218834.57	-0.23%	8131283.71	8350118.28	12	33.33%
2016-04	-941039.46	-0.99%	12482137.68	13423177.14	21	23.81%
2016-05	143103.61	0.15%	24028237.77	23885134.16	27	29.63%
2016-06	15941843.46	16.99%	29730833.07	13788989.60	12	41.67%
2016-07	5914767.90	5.39%	27254108.50	21339340.60	19	52.63%
2016-08	3025593.39	2.61%	19214240.58	16188647.20	23	52.17%
2016-09	-2165069.00	-1.82%	12309382.79	14474451.79	28	39.29%
2016-10	1097149.94	0.94%	11353355.79	10256205.85	8	37.50%
2016-11	7559340.42	6.42%	20034895.14	12475554.72	18	55.56%
2016-12	-6117370.28	-4.89%	13218147.37	19335517.65	46	13.04%
2017-01	-1358600.53	-1.14%	8161007.46	9519607.98	19	15.79%
2017-02	1694153.90	1.44%	11705998.41	10011844.51	5	40.00%
2017-03	1992646.18	1.67%	17308656.04	15316009.86	21	38.10%
2017-04	1157013.07	0.95%	19290171.89	18133158.83	35	40.00%
2017-05	3123640.24	2.55%	17986185.94	14862545.69	23	39.13%
2017-06	9321631.05	7.41%	23245773.71	13924142.66	18	77.78%
2017-07	1031673.27	0.76%	21047095.11	20015421.84	26	50.00%
2017-08	1752236.84	1.29%	24645372.65	22893135.82	34	44.12%
2017-09	3429914.35	2.49%	21849762.35	18419848.00	26	42.31%
2017-10	6152965.99	4.36%	22040971.98	15888005.99	28	53.57%
2017-11	2542562.98	1.72%	36281624.65	33739061.67	53	52.83%
2017-12	4583482.11	3.06%	23856424.98	19272942.87	64	43.75%

月盈利



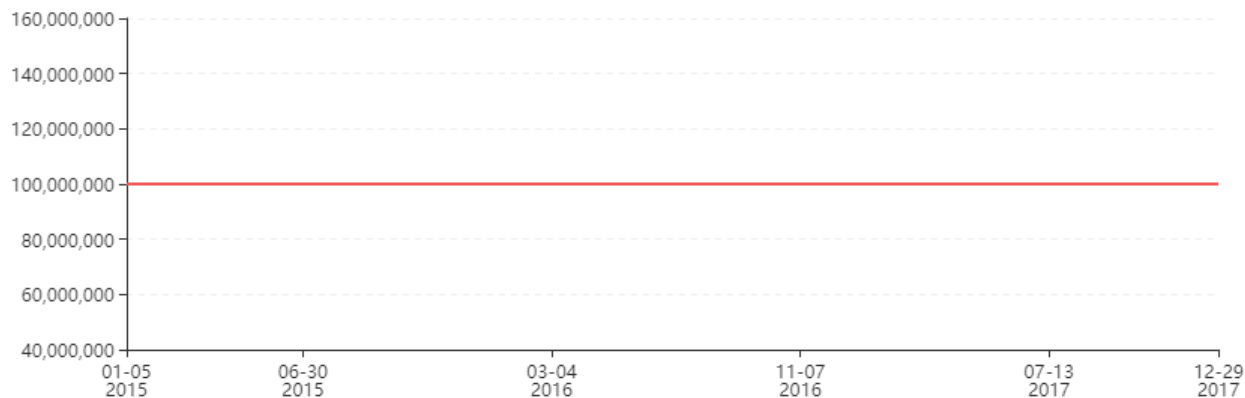


策略分析

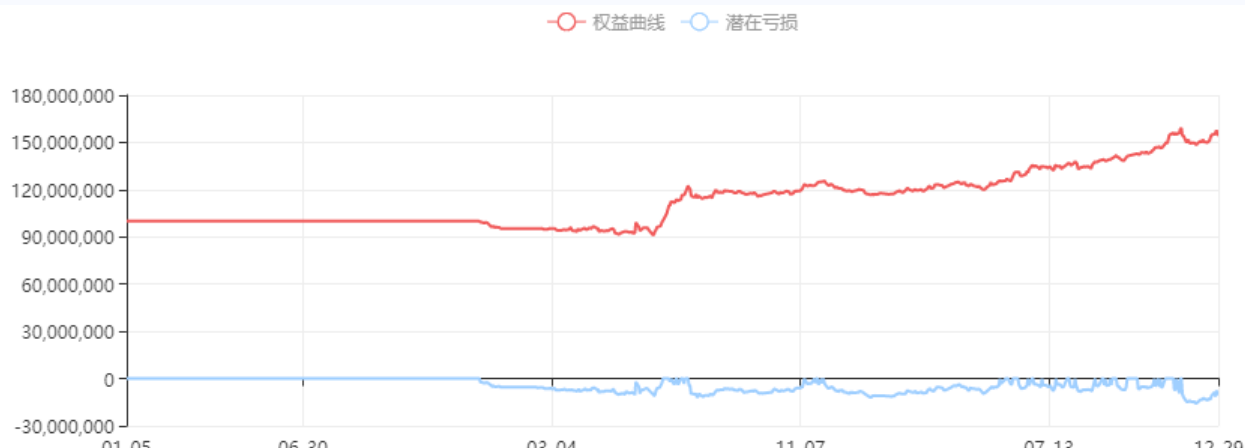
多头权益曲线



空头权益曲线



权益曲线及潜在亏损



01-03
2015

08-30
2015

03-04
2016

11-07
2016

07-13
2017

12-29
2017

策略绩效概要

初始资金	100000000.00	算术年化收益率	18.77%
初始资金收益率	54.53%	几何年化收益率	16.16%
净利	54532933.15	最大回撤	10579054.48
毛利	124838628.96	最大回撤率	8.84%
毛损	-70305695.81	已付手续费	3146878.15
盈利因子	1.78	已付滑价	0.00
多头净利	54532933.15	标的个数	245
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
1.17	1.60	1.83	0.00	0.06

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	35.04	2017-11-22 ~ 2017-12-07	27.0

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
237	24	18981728.32	-7233145.49

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)
586	26	236	350	40.27%	528977.24	-200873.42	2.63	46.68