

策略: ['market_cap_2', 'inc_revenue_lyr'] + HS300

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
策略: ['market_cap_2', 'inc_revenue_lyr'] + HS300	11.40%	4.79%	0.07	0.53	0.82	0.70	7.73%	290.27%	2023-09-01 06

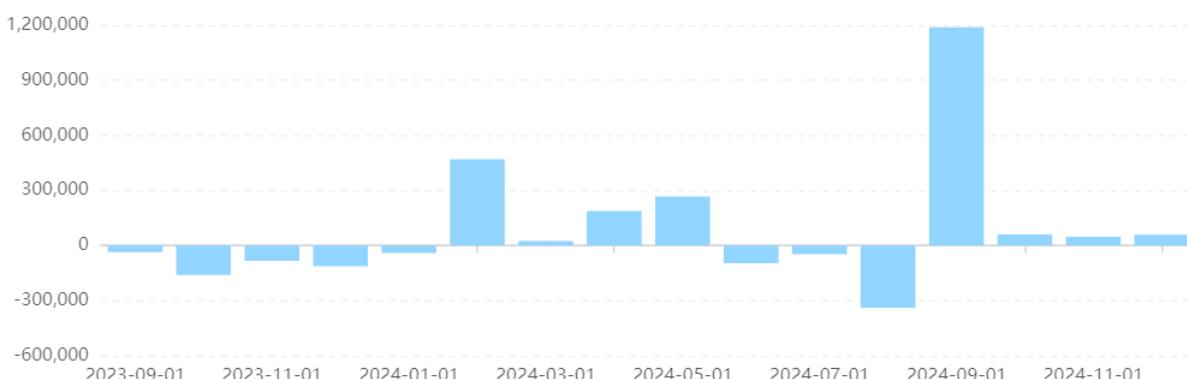
周期分析

月周期分析

月份	净利	净利率	毛利	毛损	交易次数	胜率
2023-09	-35976.08	-0.36%	412700.33	448676.41	19	57.8
2023-10	-160191.84	-1.61%	427639.20	587831.04	33	45.4
2023-11	-83389.66	-0.85%	423099.93	506489.59	31	35.4
2023-12	-112557.01	-1.16%	416156.49	528713.50	28	21.4
2024-01	-40255.54	-0.42%	676603.77	716859.31	72	38.8

日期	总资产	盈利率	净资产	负债总额	持仓数	杠杆倍数
2024-02	470987.26	4.92%	878036.84	407049.57	27	48.1
2024-03	25134.23	0.25%	678752.28	653618.05	27	62.9
2024-04	188832.08	1.88%	1090670.32	901838.24	133	62.4
2024-05	266756.75	2.60%	793003.17	526246.41	53	86.7
2024-06	-96298.36	-0.92%	520500.08	616798.44	31	77.4
2024-07	-46302.36	-0.44%	773643.55	819945.90	42	42.8
2024-08	-338532.43	-3.26%	494410.09	832942.53	44	40.9
2024-09	1188924.85	11.84%	1767940.41	579015.56	40	57.5
2024-10	60605.11	0.54%	1503223.85	1442618.74	75	93.3
2024-11	48030.52	0.43%	966108.04	918077.52	30	70.0
2024-12	60054.25	0.53%	182491.65	122437.40	216	74.0

月盈利



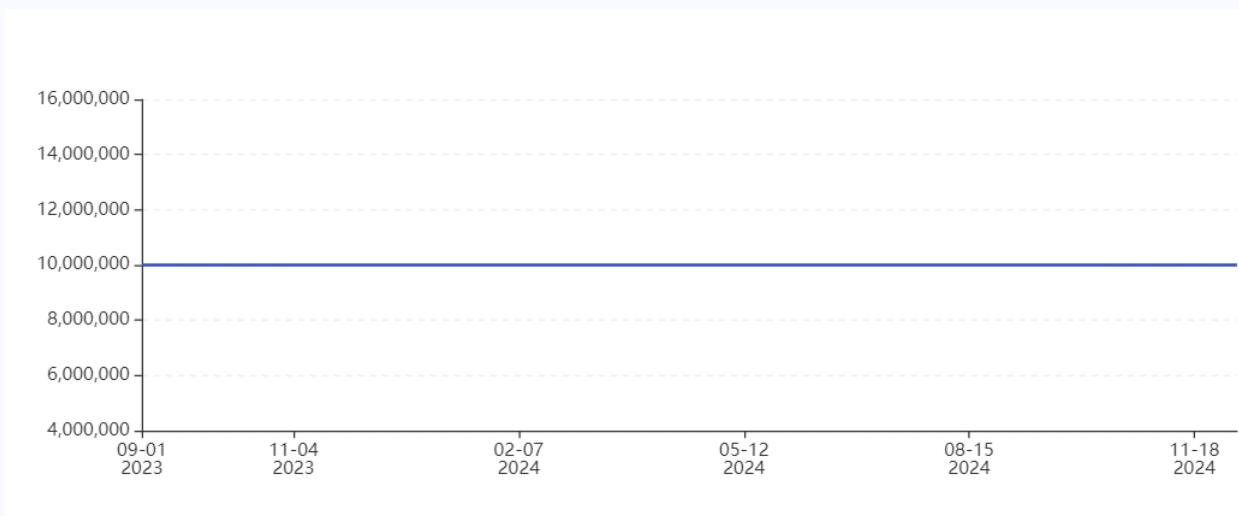
策略分析

多头权益曲线

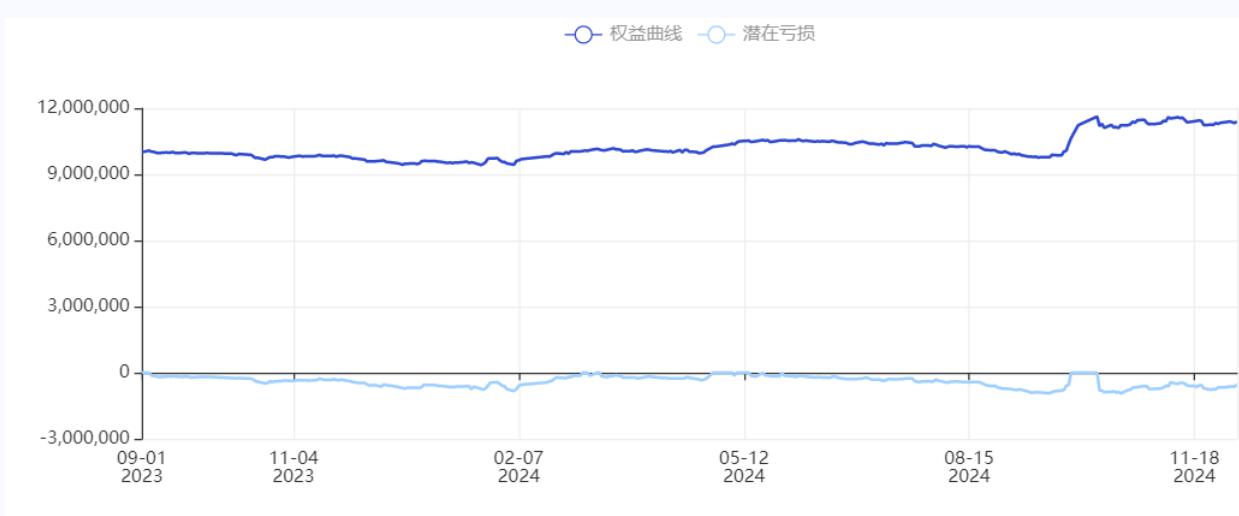




空头权益曲线



权益曲线及潜在亏损



策略绩效概要

初始资金	10000000.00	算术年化收益率	11.53%
初始资金收益率	13.96%	几何年化收益率	11.40%
净利	1395821.78	最大回撤	818459.74
毛利	2459008.31	最大回撤率	7.73%
毛损	-1063186.53	已付手续费	64056.22
盈利因子	2.31	已付滑价	0.00
多头净利	1395821.78	标的个数	46
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	1.22	1.43	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
305	109.28	2024-06-04 ~ 2024-09-13	80.0

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
6	8	1754369.84	-432402.00

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
901	200	564	337	62.60%	4359.94	-3154.86	1.38