实验总结

# 实验环境集步骤

通过 jiaoyi\_hours\_jibenmian2\_mg\_test.m 脚本对RB各个周期进行测试，

查看默认参数下MACD指标在哪个周期下效果更好些。

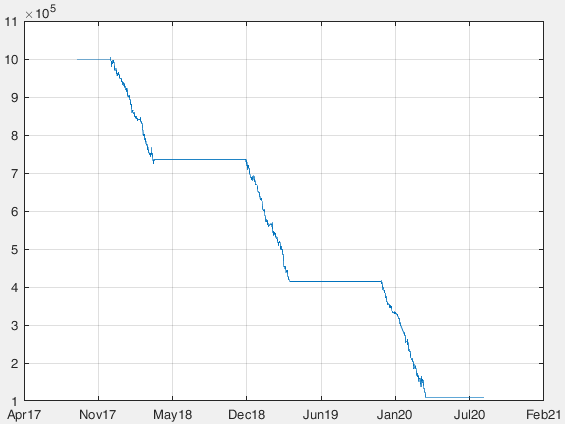
|  |
| --- |
| jiaoyi\_hours\_jibenmian2\_mg\_test.m  在元脚本jiaoyi\_hours\_jibenmian2.m基础上增加了交易时段的选择 |

实验周期包括：rb01合约 5分钟， rb01合约 10分钟

# 实验结果

## MACD 🡪《历年RB05BarSize=5高开低收.xls》

《历年RB05BarSize=5高开低收.xls》数据，每年12月1日到次年3月31日区间，MACD默认参数（12,26,9）。

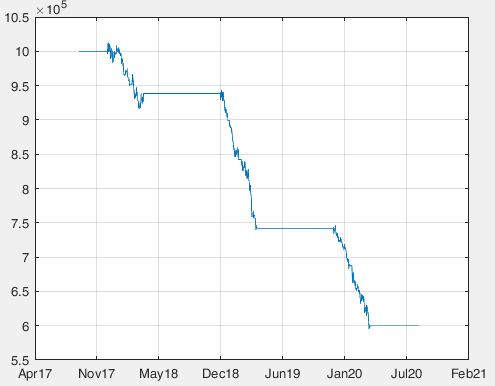


输出日至：

|  |
| --- |
| 剔除开始数据个数：20  初始资金为：1000000  最小仓位(以10吨一手记)：10手  数据个数（交易日）：49376  均线短期：20 均线长期：60  升水：200 贴水：150  开始日期：2017/09/04 结束日期：2020/09/03 间隔天数（自然日）：1095.1701  空仓交易日：30614  年均复合收益：-0.52059 结束资金为：110144.7514  最大资金回撤：-894308.3486 开始于：2017/12/04 结束于：2020/03/30  最大资金回撤比例：-0.89111 开始于：2017/12/04 结束于：2020/03/30  最长资金恢复时间：45244 开始于：2017/12/04 结束于：2020/09/03 间隔天数:1004.2118  手续费比例：0.001 手续费合计:934653.0001  最大连续盈利次数：4 最大连续亏损次数:31  单次最大盈利：16611.4 单次最大亏损:-19419.7534  平均每次交易盈亏：-692.1786 亏损平均值：-1460.7325 盈利平均值：1944.7566  交易次数：1285 盈利次数：290 亏损次数：995 盈利比例：0.22568  盈利累计：563979.428 亏损累计：-1453428.8766 总盈利/总亏损：0.38803 平均盈利/平均亏损：1.3314  平均持仓天数：0.85227 最长持仓天数：245 平均盈利持仓时间：0.50823 平均亏损持仓时间：0.70414  标准离差率：-2.8245 凯利指数：-0.35592 循环比：-2.0997 悲观利润率（大于2好，大于2.5优秀）：0.37721 保守利润指数：0.35567  按每次完整交易， 最大资金回撤：-890793.7486 开始于：2017/12/04 结束于：2020/03/30  最大资金回撤比例：-0.89054 开始于：2017/12/04 结束于：2020/03/30 年度复合回报/最大回撤比例:-0.58451  最长资金恢复时间(交易次数)：1284 开始于：2017/12/04 结束于：2020/03/31 间隔天数:847.9549 |

## MACD 🡪 《历年RB05BarSize=10高开低收.xls》

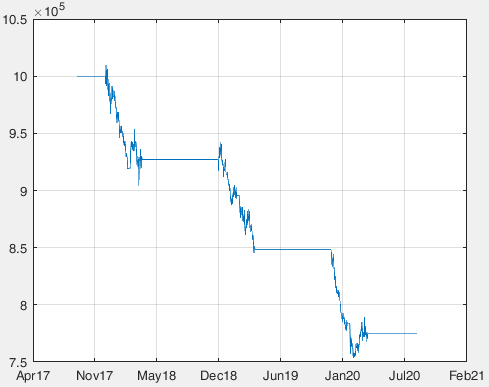
《历年RB05BarSize=20高开低收.xls》数据，每年12月1日到次年3月31日区间，MACD默认参数（12,26,9）。



|  |
| --- |
| 剔除开始数据个数：20  初始资金为：1000000  最小仓位(以10吨一手记)：10手  数据个数（交易日）：25014  均线短期：20 均线长期：60  升水：200 贴水：150  开始日期：2017/09/04 结束日期：2020/09/03 间隔天数（自然日）：1095.0208  空仓交易日：15515  年均复合收益：-0.15673 结束资金为：599655.1  最大资金回撤：-417203.4 开始于：2017/12/06 结束于：2020/03/27  最大资金回撤比例：-0.41194 开始于：2017/12/06 结束于：2020/03/27  最长资金恢复时间：22852 开始于：2017/12/06 结束于：2020/09/03 间隔天数:1002.1667  手续费比例：0.001 手续费合计:474644.9  最大连续盈利次数：5 最大连续亏损次数:18  单次最大盈利：19416.4 单次最大亏损:-23354.6  平均每次交易盈亏：-611.5275 亏损平均值：-1821.6006 盈利平均值：2599.5603  交易次数：654 盈利次数：179 亏损次数：475 盈利比例：0.2737  盈利累计：465321.3 亏损累计：-865260.3 总盈利/总亏损：0.53778 平均盈利/平均亏损：1.4271  平均持仓天数：1.6743 最长持仓天数：245 平均盈利持仓时间：0.98064 平均亏损持仓时间：1.4157  标准离差率：-4.5317 凯利指数：-0.23524 循环比：-1.2266 悲观利润率（大于2好，大于2.5优秀）：0.52151 保守利润指数：0.46766  按每次完整交易， 最大资金回撤：-414717.4 开始于：2017/12/06 结束于：2020/03/27  最大资金回撤比例：-0.41049 开始于：2017/12/06 结束于：2020/03/27 年度复合回报/最大回撤比例:-0.38152  最长资金恢复时间(交易次数)：652 开始于：2017/12/06 结束于：2020/03/31 间隔天数:845.8125 |

## MACD 🡪 《历年RB05BarSize=20高开低收.xls》

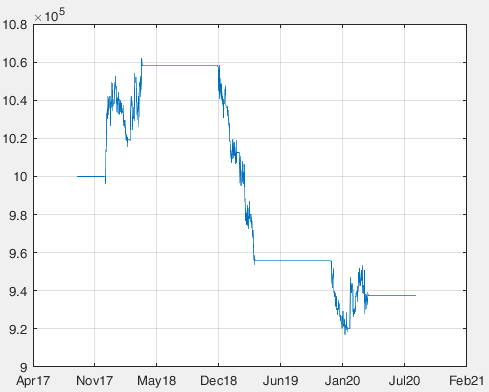
《历年RB05BarSize=20高开低收.xls》数据，每年12月1日到次年3月31日区间，MACD默认参数（12,26,9）。



|  |
| --- |
| 剔除开始数据个数：20  初始资金为：1000000  最小仓位(以10吨一手记)：10手  数据个数（交易日）：13542  均线短期：20 均线长期：60  升水：200 贴水：150  开始日期：2017/09/05 结束日期：2020/09/03 间隔天数（自然日）：1094.2361  空仓交易日：8409  年均复合收益：-0.081661 结束资金为：774614.9  最大资金回撤：-256025.4 开始于：2017/12/06 结束于：2020/02/12  最大资金回撤比例：-0.25347 开始于：2017/12/06 结束于：2020/02/12  最长资金恢复时间：12369 开始于：2017/12/06 结束于：2020/09/03 间隔天数:1001.7361  手续费比例：0.001 手续费合计:265085.1  最大连续盈利次数：5 最大连续亏损次数:16  单次最大盈利：22628 单次最大亏损:-23753.8  平均每次交易盈亏：-616.374 亏损平均值：-2499.0844 盈利平均值：3805.4046  交易次数：365 盈利次数：109 亏损次数：256 盈利比例：0.29863  盈利累计：414789.1 亏损累计：-639765.6 总盈利/总亏损：0.64835 平均盈利/平均亏损：1.5227  平均持仓天数：2.9979 最长持仓天数：245 平均盈利持仓时间：1.69 平均亏损持仓时间：2.5929  标准离差率：-6.2475 凯利指数：-0.16197 循环比：-0.8259 悲观利润率（大于2好，大于2.5优秀）：0.62533 保守利润指数：0.53768  按每次完整交易， 最大资金回撤：-252660.8 开始于：2017/12/06 结束于：2020/02/11  最大资金回撤比例：-0.25078 开始于：2017/12/06 结束于：2020/02/11 年度复合回报/最大回撤比例:-0.32513  最长资金恢复时间(交易次数)：363 开始于：2017/12/06 结束于：2020/03/31 间隔天数:845.4861 |

## MACD 🡪 《历年RB05BarSize=30高开低收.xls》

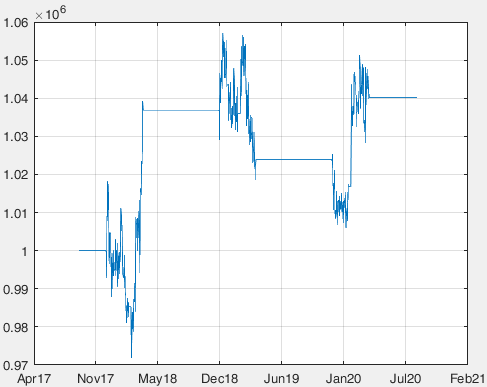
《历年RB05BarSize=30高开低收.xls》数据，每年12月1日到次年3月31日区间，MACD默认参数（12,26,9）。



|  |
| --- |
| 剔除开始数据个数：20  初始资金为：1000000  最小仓位(以10吨一手记)：10手  数据个数（交易日）：8549  均线短期：20 均线长期：60  升水：200 贴水：150  开始日期：2017/09/05 结束日期：2020/09/03 间隔天数（自然日）：1094  空仓交易日：5304  年均复合收益：-0.021332 结束资金为：937413.7  最大资金回撤：-145168.9 开始于：2018/03/30 结束于：2020/01/16  最大资金回撤比例：-0.1367 开始于：2018/03/30 结束于：2020/01/16  最长资金恢复时间：6900 开始于：2018/03/30 结束于：2020/09/03 间隔天数:887.6667  手续费比例：0.001 手续费合计:170686.3  最大连续盈利次数：4 最大连续亏损次数:12  单次最大盈利：24535.2 单次最大亏损:-12383.8  平均每次交易盈亏：-263.4657 亏损平均值：-2803.5554 盈利平均值：4784.5608  交易次数：236 盈利次数：79 亏损次数：157 盈利比例：0.33475  盈利累计：377980.3 亏损累计：-440158.2 总盈利/总亏损：0.85874 平均盈利/平均亏损：1.7066  平均持仓天数：4.6356 最长持仓天数：245 平均盈利持仓时间：2.7471 平均亏损持仓时间：4.019  标准离差率：-18.5097 凯利指数：-0.055066 循环比：-0.28074 悲观利润率（大于2好，大于2.5优秀）：0.82822 保守利润指数：0.70745  按每次完整交易， 最大资金回撤：-139911 开始于：2018/04/02 结束于：2020/01/15  最大资金回撤比例：-0.13223 开始于：2018/04/02 结束于：2020/01/15 年度复合回报/最大回撤比例:-0.16031  最长资金恢复时间(交易次数)：171 开始于：2018/04/02 结束于：2020/03/31 间隔天数:729 |

## MACD 🡪 《历年RB05BarSize=60高开低收.xls》

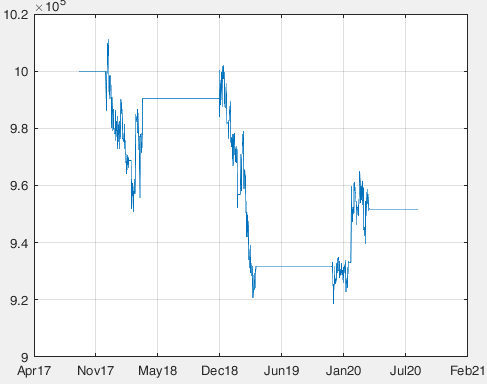
《历年RB05BarSize=60高开低收.xls》数据，每年12月1日到次年3月31日区间，MACD默认参数（12,26,9）。



|  |
| --- |
| 剔除开始数据个数：20  初始资金为：1000000  最小仓位(以10吨一手记)：10手  数据个数（交易日）：4974  均线短期：20 均线长期：60  升水：200 贴水：150  开始日期：2017/09/06 结束日期：2020/09/03 间隔天数（自然日）：1092.7083  空仓交易日：3086  年均复合收益：0.013243 结束资金为：1040172.1  最大资金回撤：-50943 开始于：2018/12/14 结束于：2020/01/16  最大资金回撤比例：-0.048199 开始于：2018/12/14 结束于：2020/01/16  最长资金恢复时间：2942 开始于：2018/12/14 结束于：2020/09/03 间隔天数:628.6667  手续费比例：0.001 手续费合计:89127.9  最大连续盈利次数：5 最大连续亏损次数:8  单次最大盈利：27939.2 单次最大亏损:-9513.8  平均每次交易盈亏：327.2669 亏损平均值：-3233.9243 盈利平均值：5597.83  交易次数：124 盈利次数：50 亏损次数：74 盈利比例：0.40323  盈利累计：279891.5 亏损累计：-239310.4 总盈利/总亏损：1.1696 平均盈利/平均亏损：1.731  平均持仓天数：8.8122 最长持仓天数：245 平均盈利持仓时间：4.6567 平均亏损持仓时间：8.3131  标准离差率：18.5022 凯利指数：0.058463 循环比：0.25097 悲观利润率（大于2好，大于2.5优秀）：1.1363 保守利润指数：0.86713  按每次完整交易， 最大资金回撤：-46258.2 开始于：2018/12/17 结束于：2020/01/15  最大资金回撤比例：-0.043949 开始于：2018/12/17 结束于：2020/01/15 年度复合回报/最大回撤比例:0.30448  最长资金恢复时间(交易次数)：85 开始于：2018/12/17 结束于：2020/03/31 间隔天数:469.9583 |

## MACD 🡪 《历年RB05BarSize=120高开低收.xls》

《历年RB05BarSize=30高开低收.xls》数据，每年12月1日到次年3月31日区间，MACD默认参数（12,26,9）。



|  |
| --- |
| 剔除开始数据个数：20  初始资金为：1000000  最小仓位(以10吨一手记)：10手  数据个数（交易日）：4151  均线短期：20 均线长期：60  升水：200 贴水：150  开始日期：2017/09/07 结束日期：2020/09/03 间隔天数（自然日）：1092.1667  空仓交易日：2618  年均复合收益：-0.016388 结束资金为：951758.9  最大资金回撤：-92441.4 开始于：2017/12/12 结束于：2019/12/06  最大资金回撤比例：-0.091418 开始于：2017/12/12 结束于：2019/12/06  最长资金恢复时间：3773 开始于：2017/12/12 结束于：2020/09/03 间隔天数:996.25  手续费比例：0.001 手续费合计:82541.1  最大连续盈利次数：3 最大连续亏损次数:6  单次最大盈利：31656.2 单次最大亏损:-9935.2  平均每次交易盈亏：-416.0052 亏损平均值：-3833.7368 盈利平均值：6244.1897  交易次数：115 盈利次数：39 亏损次数：76 盈利比例：0.33913  盈利累计：243523.4 亏损累计：-291364 总盈利/总亏损：0.8358 平均盈利/平均亏损：1.6287  平均持仓天数：9.4971 最长持仓天数：247.4167 平均盈利持仓时间：5.3291 平均亏损持仓时间：8.4496  标准离差率：-15.9195 凯利指数：-0.066623 循环比：-0.31997 悲观利润率（大于2好，大于2.5优秀）：0.79292 保守利润指数：0.57902  按每次完整交易， 最大资金回撤：-83941.4 开始于：2017/12/08 结束于：2019/12/06  最大资金回撤比例：-0.083716 开始于：2017/12/08 结束于：2019/12/06 年度复合回报/最大回撤比例:-0.19419  最长资金恢复时间(交易次数)：112 开始于：2017/12/08 结束于：2020/03/31 间隔天数:843.0833 |