

# S1背离反转策略回测

回测日期：2019-8-18  
回测交易所：BITMEX  
品种：XBTUSD 时间级别：5分钟 回测K线数：206317

- 基本原理：使用RSI背离指标，结合波动性和交易量和轴枢点位置等做短线反转
- 优势：牛市中的回调会买入，熊市中也会有很好的抗风险能力
- 交易方式：程序全自动化交易，亦可以辅助人工操作, 结合常见顶部形态可将策略关闭即可
- 杠杆倍数：小于3
- 备注：最大回撤出现在2018年11月份，那是BCH分叉事件导致，可以人工避免那段交易

## 收益曲线

复利收益曲线：1=初始仓位大小，2表示收益100%，依次类推; 回撤：-1表示亏损100%，爆仓



绩效总结

每次开仓是单位1个BTC

	全部	做多	做空
净利润	\$13476.90	\$13476.90	\$0.00
毛利润	\$20490.30	\$20490.30	\$0.00
毛亏损	\$-7013.40	\$-7013.40	\$0.00
最大回撤	\$-1311.50	\$-1311.50	\$0.00
盈利因子	2.921592950637352	2.921592950637352	NaN
最大持仓	100.00%	100.00%	0.00%
所有已平仓交易	178	178	0
获利交易次数	135	135	0
亏损交易次数	43	43	0
胜率	75.84%	75.84%	NaN%
平均交易	\$75.71	\$75.71	\$NaN
平均盈利交易	\$151.78	\$151.78	\$NaN
平均亏损交易	\$-163.10	\$-163.10	\$NaN
全部交易的平均持仓K线根数	99.63483146067416	99.63483146067416	NaN
盈利交易的平均持仓K线根数	80.18518518518519	80.18518518518519	NaN
亏损交易的平均持仓K线根数	160.69767441860466	160.69767441860466	NaN