

S1背离反转策略回测

回测日期：2019-10-14

回测交易所：BITMEX

品种：XBTUSD 时间级别：5分钟 回测K线数：222769

- 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	\$13492.90	\$13492.90	\$0.00
毛利润	\$20721.30	\$20721.30	\$0.00
毛亏损	\$-7228.40	\$-7228.40	\$0.00
最大回撤	\$-1311.50	\$-1311.50	\$0.00
盈利因子	2.8666509877704613	2.8666509877704613	NaN
最大持仓	100.00%	100.00%	0.00%
所有已平仓交易	184	184	0
获利交易次数	139	139	0
亏损交易次数	45	45	0
胜率	75.54%	75.54%	NaN%
平均交易	\$73.33	\$73.33	\$NaN
平均盈利交易	\$149.07	\$149.07	\$NaN
平均亏损交易	\$-160.63	\$-160.63	\$NaN
全部交易的平均持仓K线根数	101.22826086956522	101.22826086956522	NaN
盈利交易的平均持仓K线根数	80.24460431654676	80.24460431654676	NaN
亏损交易的平均持仓K线根数	166.04444444444445	166.04444444444445	NaN