

XBTUSD_breakcandle5m_48_0601

回测日期：2019-8-7
回测交易所：BITMEX
品种：XBTUSD
时间级别：5分钟
回测K线数：201995

- 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



绩效总结

每次开仓是单位1个BTC

	全部	做多	做空
净利润	\$12822.80	\$0.00	\$12822.80
毛利润	\$30129.80	\$0.00	\$30129.80
毛亏损	\$-17307.00	\$0.00	\$-17307.00
最大回撤	\$-2631.50	\$0.00	\$-2631.50
盈利因子	1.7409025249898884	NaN	1.7409025249898884
最大持仓	100.00%	0.00%	100.00%
所有已平仓交易	112	0	112
获利交易次数	52	0	52
亏损交易次数	60	0	60
胜率	46.43%	NaN%	46.43%
平均交易	\$114.49	\$NaN	\$114.49
平均盈利交易	\$579.42	\$NaN	\$579.42
平均亏损交易	\$-288.45	\$NaN	\$-288.45
全部交易的平均持仓K线根数	2	NaN	2
盈利交易的平均持仓K线根数	2	NaN	2
亏损交易的平均持仓K线根数	2	NaN	2