

## S2放量突破策略回测

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：日线指标为上涨趋势，结合小时线放量，5分钟趋势K线突破高点，等待回撤后的高4点位
- 优势：严格的止盈止损
- 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

### 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	\$15428.50	\$15428.50	\$0.00
毛利润	\$24038.80	\$24038.80	\$0.00
毛亏损	<span>\$-8610.30</span>	<span>\$-8610.30</span>	\$0.00
最大回撤	<span>\$-1630.00</span>	<span>\$-1630.00</span>	\$0.00
盈利因子	2.7918655563685357	2.7918655563685357	NaN
最大持仓	100.00%	100.00%	0.00%
所有已平仓交易	132	132	0
获利交易次数	78	78	0
亏损交易次数	54	54	0
胜率	59.09%	59.09%	NaN%
平均交易	\$116.88	\$116.88	\$NaN
平均盈利交易	\$308.19	\$308.19	\$NaN
平均亏损交易	<span>\$-159.45</span>	<span>\$-159.45</span>	\$NaN
全部交易的平均持仓K线根数	272.0378787878788	272.0378787878788	NaN
盈利交易的平均持仓K线根数	375.7564102564103	375.7564102564103	NaN
亏损交易的平均持仓K线根数	122.22222222222223	122.22222222222223	NaN