## 策略基本信息

|  |  |
| --- | --- |
| Strategy Name | Donchian |
| Markets to Test | IF88:CTP |
| Historical Test Period | 20180202 to 20190225 |
| Observation Bar Size | 15Min |
| Entry Rules | Close price break Donchian bands |
| Exit Rules | Volatility filtration and signals combination |

## 仓位管理+止盈止损

|  |  |
| --- | --- |
| 仓位管理 | NA |
| 止盈 | NA |
| 止损 | NA |

## 品种样本测试

#### IF88:CTP

|  |  |
| --- | --- |
| In Period Parameters | ema 15 donchian 20 atr 15 |
| In Period Performance | Sharpe Ratio 1.25 |
| Fitness Function | Sharpe Ratio |
| Real Time Period | 20180202 to 20190225 |
| Net Profit | 7,198.55 |
| Maximum Draw Down | -2718.95 |

#### 

2019-06-24 22:54:11.771230 总交易日： 254

2019-06-24 22:54:11.771230 盈利交易日 103

2019-06-24 22:54:11.772233 亏损交易日： 123

2019-06-24 22:54:11.772233 起始资金： 1000000

2019-06-24 22:54:11.772233 结束资金： 1,007,198.55

2019-06-24 22:54:11.772233 总收益率： 0.72%

2019-06-24 22:54:11.772233 年化收益： 0.68%

2019-06-24 22:54:11.773158 总盈亏： 7,198.55

2019-06-24 22:54:11.773158 最大回撤: -2,718.95

2019-06-24 22:54:11.773158 百分比最大回撤: -0.27%

2019-06-24 22:54:11.773158 总手续费： 7,315.95

2019-06-24 22:54:11.773158 总滑点： 2,080.0

2019-06-24 22:54:11.773158 总成交金额： 14,631,894.5

2019-06-24 22:54:11.773158 总成交笔数： 416

2019-06-24 22:54:11.774158 日均盈亏： 28.34

2019-06-24 22:54:11.774158 日均手续费： 28.8

2019-06-24 22:54:11.774158 日均滑点： 8.19

2019-06-24 22:54:11.774158 日均成交金额： 57,605.88

2019-06-24 22:54:11.774158 日均成交笔数： 1.64

2019-06-24 22:54:11.774158 日均收益率： 0.0%

2019-06-24 22:54:11.774158 收益标准差： 0.04%

2019-06-24 22:54:11.775167 Sharpe Ratio： 1.25