

客户账户 诊断报告

CUSTOMER
ACCOUNT
DIAGNOSTIC
REPORT

客户账号 : XXXX

客户名称 : XXXX

统计区间 : 20240101 ~ 20240604

一、资金状况分析

账户概要					
期初权益 (元)	112.47	期末权益 (元)	0.00	市值权益 (元)	0.00
交易盈亏 (元)	-3740.00	手续费 (元)	101.47	净利润 (元)	-3841.47
净入金 (元)	20992.00	权利金收入 (元)	0.00	权利金支出 (元)	0.00
盈利天数 (天)	21	亏损天数 (天)	22	交易胜率 (%)	48.84
成交量	34	夏普比率	-1.29	累计收益率	-100.00

(手)				(%)	
-----	--	--	--	-----	--

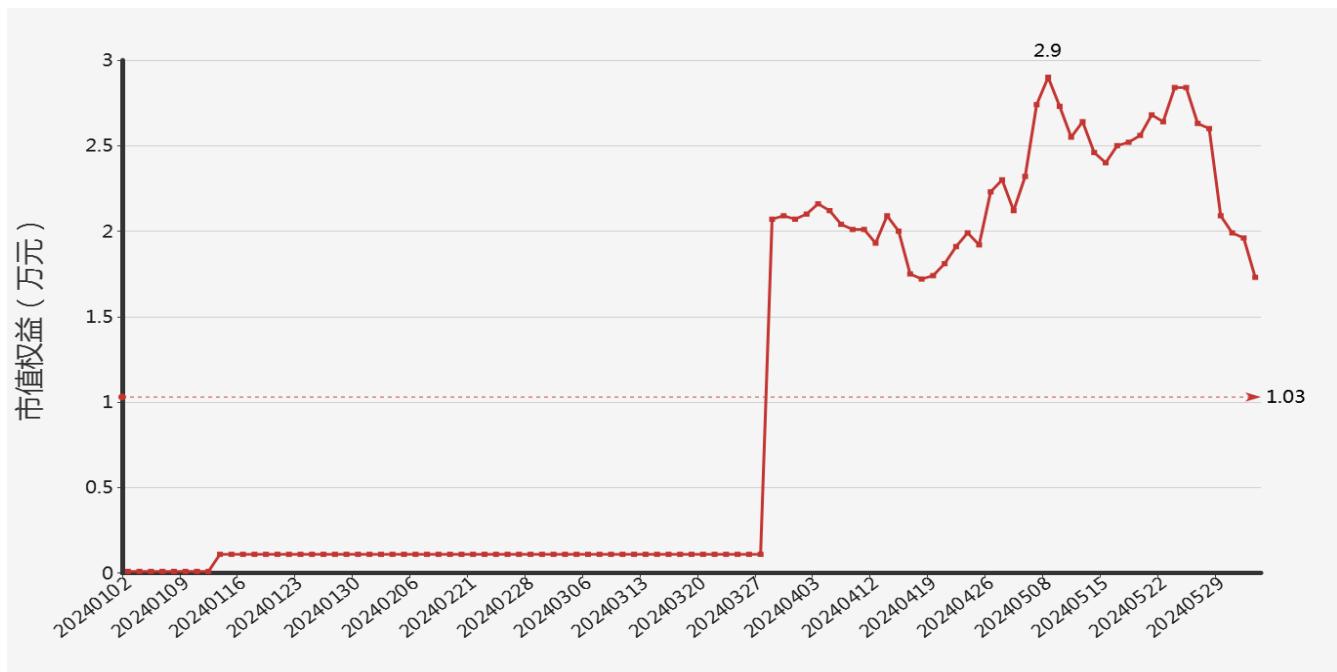
小结分析：

您的夏普比率为-1.29，您投资组合的单位风险对应的超额收益表现一般，建议您优化投资策略，改进风控手段，提高投资效率。

你的交易胜率为48.84%，您对投资机会判断的准确率较高，希望您持续对市场变化保持密切关注。

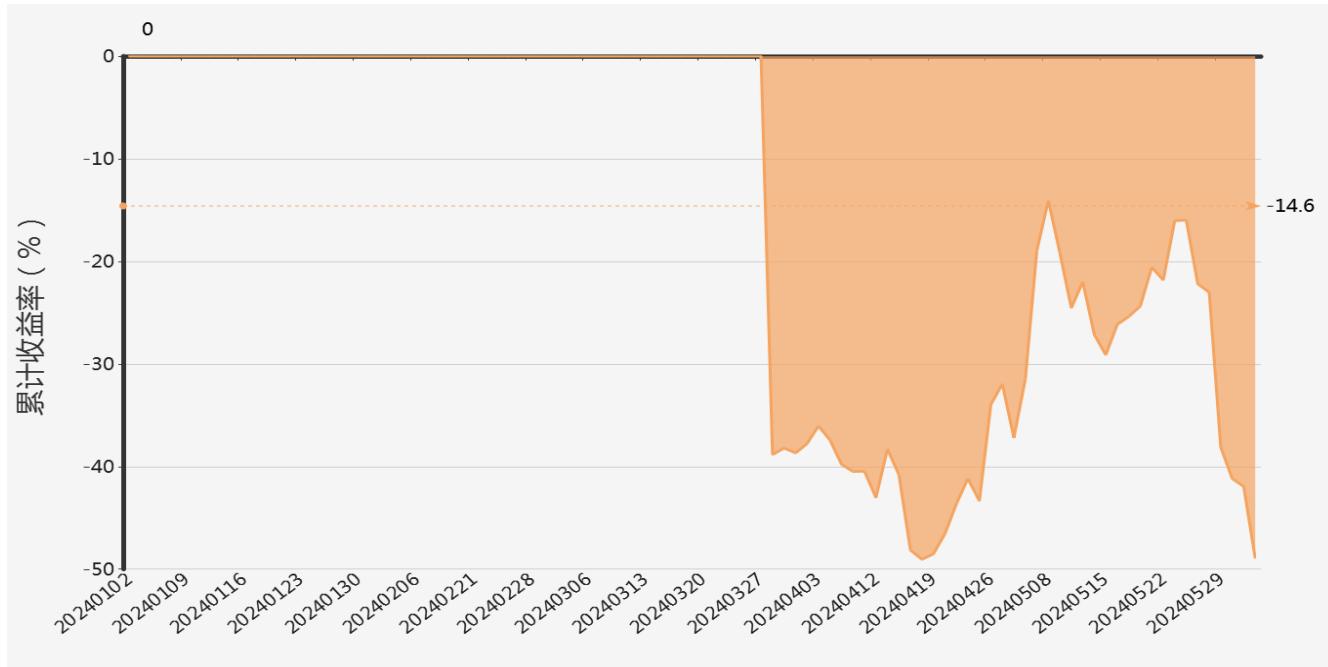
二、趋势分析

市值权益曲线



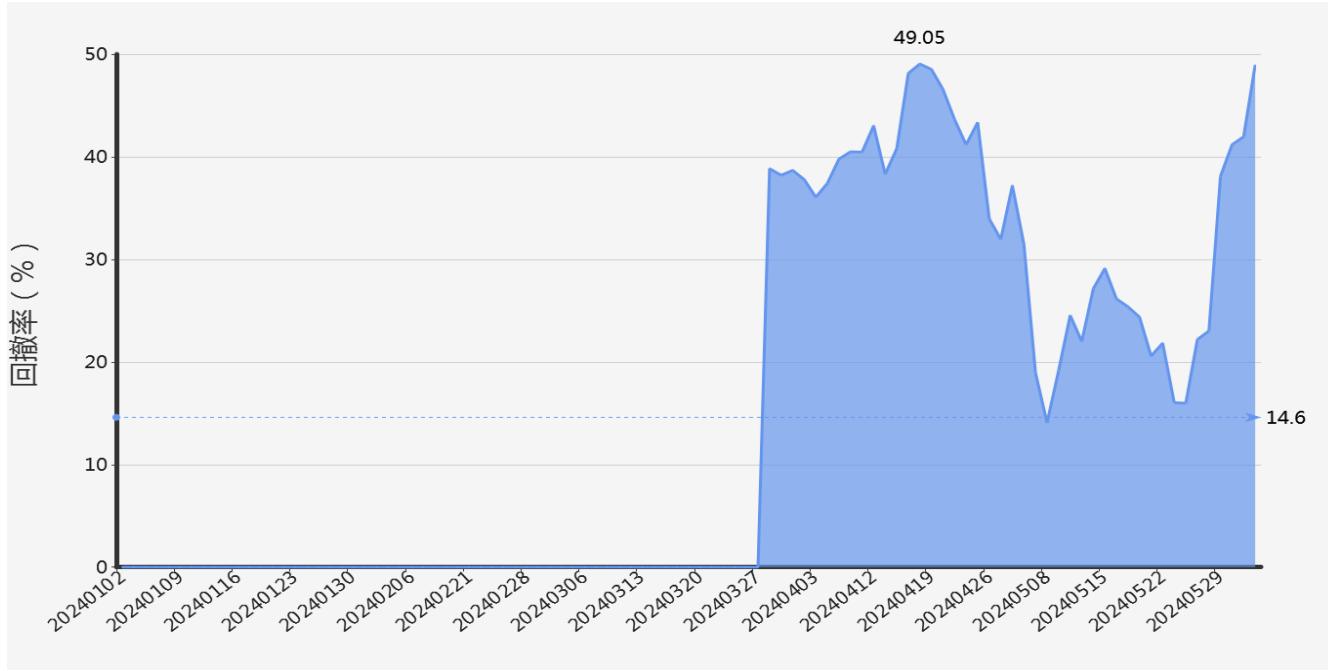
统计时间区间为 20240101 ~ 20240604 的市值权益

累计收益率曲线



统计时间区间为 20240101 ~ 20240604 的累计收益率

回撤曲线



统计时间区间为 20240101 ~ 20240604 的回撤率

小结分析：

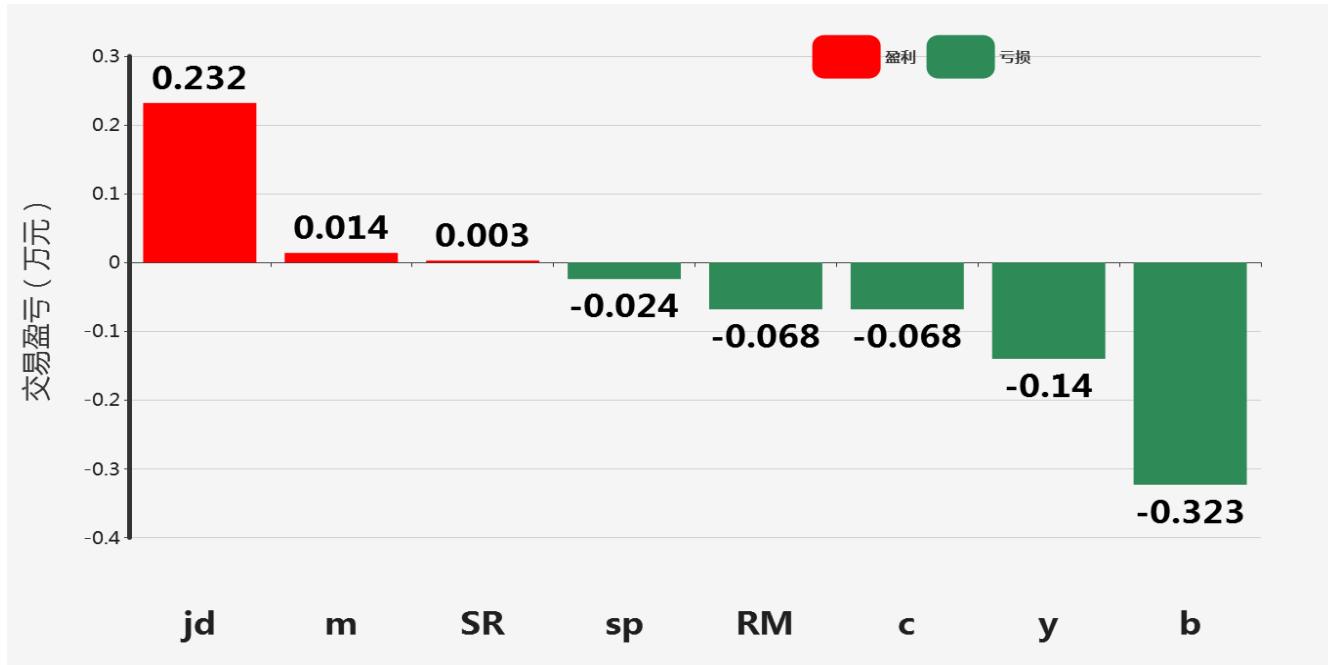
您的最大回撤率为 49.05%，您的最大回撤（即累计净值从最高点开始回落到最低点的幅度）较大，易出现连续亏损的极端情况，建议您注意仓位控制，适时进行止损等风险控制操作。

三、品种交易偏好分析

品种偏好分析								
品种	日内成交量	总成交量	成交额	平仓盈亏	持仓盈亏	交易盈亏	手续费	净利润
JD	4	12	44.08	-3,150.00	5,470.00	2,320.00	66.29	2,253.71
M	0	2	6.92	0.00	140.00	140.00	3.02	136.98
SR	2	2	12.96	30.00	0.00	30.00	3.03	26.97
SP	0	2	12.22	220.00	-460.00	-240.00	6.15	-246.15
C	0	4	9.80	0.00	-680.00	-680.00	4.84	-684.84
RM	2	6	16.13	-110.00	-570.00	-680.00	9.06	-689.06
Y	0	2	15.20	-1,100.00	-300.00	-1,400.00	5.04	-1,405.04
B	0	4	16.28	-1,580.00	-1,650.00	-3,230.00	4.04	-3,234.04
null	8	34	133.58	-5,690.00	1,950.00	-3,740.00	101.47	-3,841.47

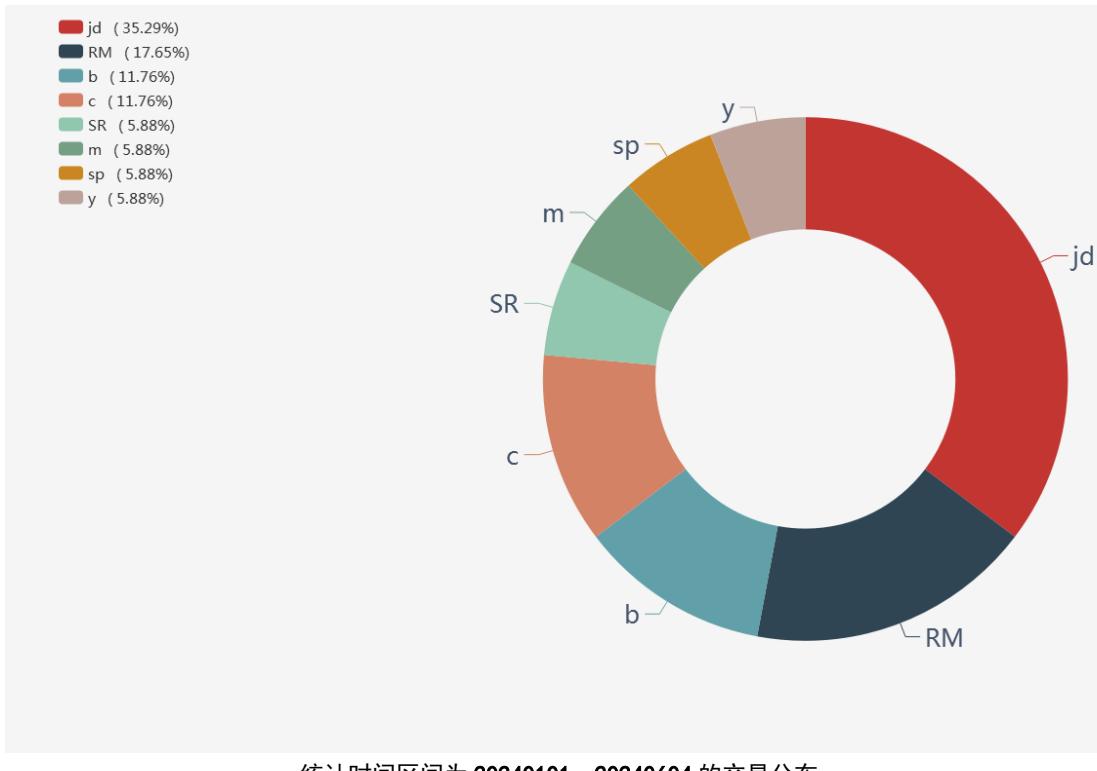
注：日内成交量和总成交量单位为手，成交额单位为万元，其他栏目单位为元。

品种盈亏分析



统计时间区间为 20240101 ~ 20240604 的品种盈亏

交易分布



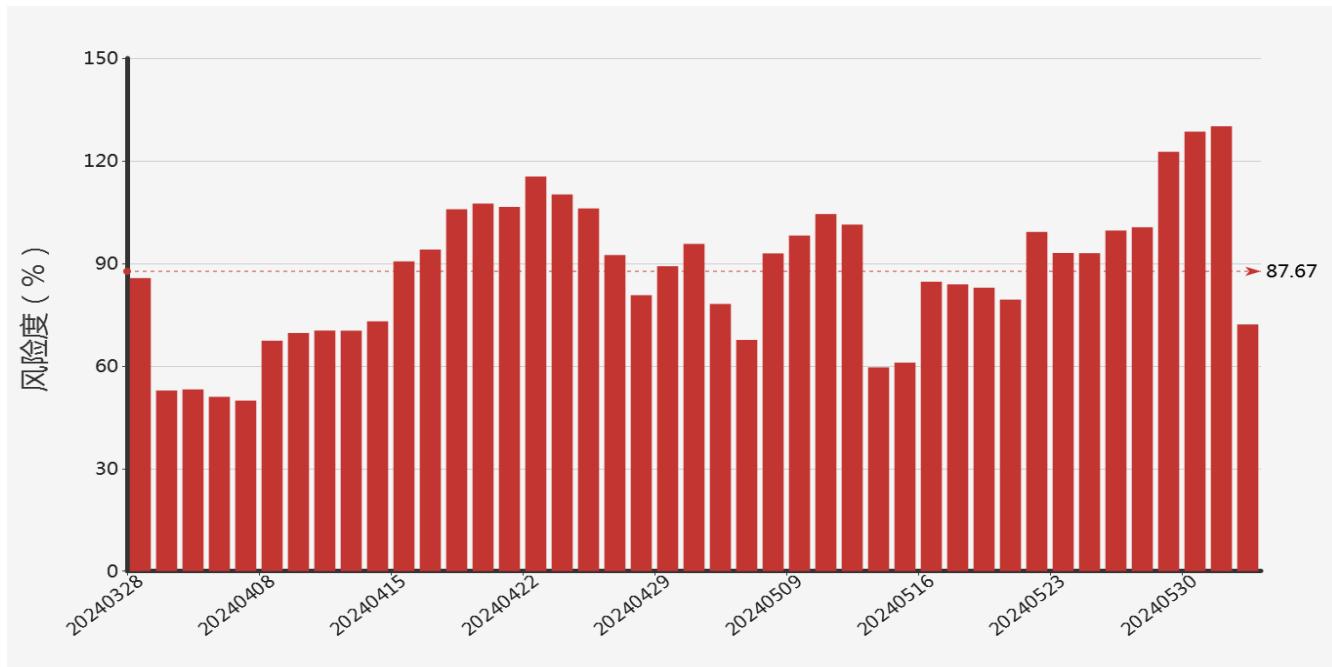
统计时间区间为 20240101 ~ 20240604 的交易分布

小结分析：

您对 jd, RM, b, c, SR 品种的参与热情较高，为您带来收益贡献最大的品种为：jd, m, SR，亏损最大的品种为：b, y, RM, c, sp。

四、风险分析

风险度分析



统计时间区间为 20240101 ~ 20240604 的风险度

小结分析：

您的日均风险度为 87.67%，您账户的总体风险度较高，请您注意仓位控制，关注市场波动，建立止损机制，谨防行情波动可能带来的强平风险。

五、报告总结

您在 20240101~20240604 期间的账户总体盈亏为 -3740.00 元，交易天数为 43 天，交易总手数为 34 手。

您的夏普比率为 -1.29，您投资组合的单位风险对应的超额收益表现一般，建议您优化投资策略，改进风控手段，提高投资效率。

您的最大回撤率为 49.05%，您的最大回撤（即累计净值从最高点开始回落到最低点的幅度）较大，易出现连续亏损的极端情况，建议您注意仓位控制，适时进行止损等风险控制操作。

您的交易品种有 8 个，您对 jd, RM, b, c, SR 品种的参与热情较高，为您带来收益贡献最大的品种为：jd, m, SR，亏损最大的品种为：b, y, RM, c, sp。

您的日均风险度为 87.67%，您账户的总体风险度较高，请您注意仓位控制，关注市场波动，建立止损机制，谨防行情波动可能带来的强平风险。

重要声明：

本交易报告不构成投资建议，不代表通惠期货观点。通惠期货对信息的准确性和完整性不作保证，不承诺所包含的信息不会发生变更。报告中任何观点及结论仅供参考，任何据此做出的投资决策与通惠期货无关。您的历史业绩表现不代表未来预期收益，期货市场投资有风险，决策须谨慎。

报告生成日期：2024年06月04日