

赢在当下

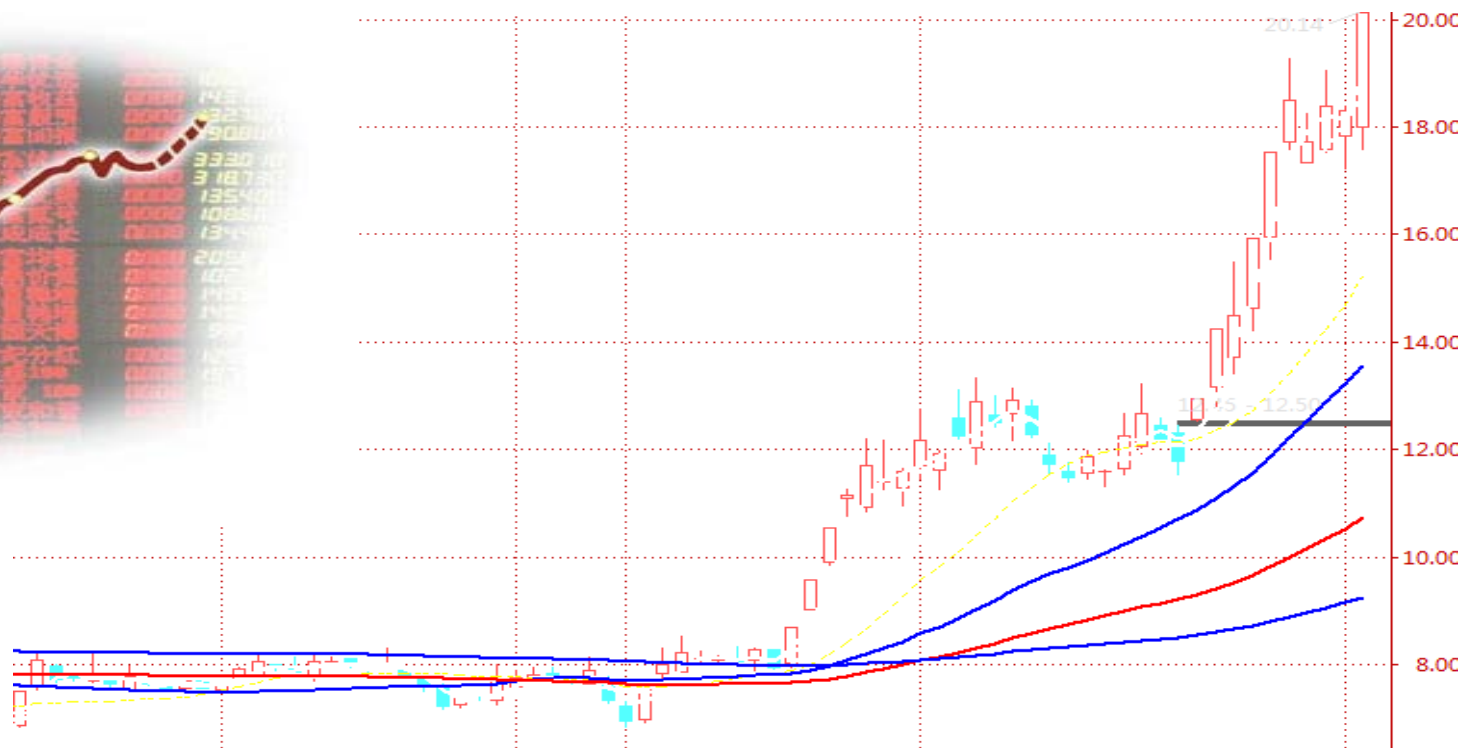


打造数据化的交易系统

... 汤承彪



系
统
、
、
、





数

据

交易汇总	交易分析	交易记录	平仓分析	阶段总结	资产变化	图表分析	系统设置
------	------	------	------	------	------	------	------

性能概要			
统计指标	全部交易	多头	空头
净利润	17000.00	17000.00	0.00
总盈利	19310.00	19310.00	0.00
总亏损	(2310.00)	(2310.00)	0.00
总盈利/总亏损	8.36	8.36	0.00
交易手数	14	14	0
盈利比率	50.00%	50.00%	0.00%
盈利手数	7	7	0
亏损手数	7	7	0
持平手数	0	0	0
平均利润	1214.29	1214.29	0.00
平均盈利	2758.57	2758.57	0.00
平均亏损	(330.00)	(330.00)	0.00
平均盈利/平均亏损	8.36	8.36	0.00

最大盈利	9440.00	9440.00	0.00
最大亏损	(780.00)	(780.00)	0.00
最大盈利/总盈利	0.49	0.49	0.00
最大亏损/总亏损	0.34	0.34	0.00
净利润/最大亏损	21.79	21.79	0.00
最大连续盈利手数	3	3	0
最大连续亏损手数	3	3	0
平均持仓周期	15	15	0
平均盈利周期	23	23	0
平均亏损周期	7	7	0
平均持平周期	0	0	0
最大使用资金	9412.00	9412.00	0.00
最大持仓手数	1.00	1.00	0.00
交易成本合计	140.00	140.00	0.00
收益率	0.17%		
年化收益率	1292.68%		
有效收益率	180.62%		
月度平均盈利	10166.67		
收益曲线斜率	0.4307		
收益曲线截距	-44.33		
收益曲线R平方值	0.8140		
夏普比率	7.8636		
总交易时间	51天		
持仓时间比率	43.88%		
持仓时间	22天		
最大空仓时间	11天		
持仓周期	215		

资产最大升水	18510.00
发生时间	2018/05/22 09:00
最大升水/前期低点	0.19%
单日最大资产回撤比率	0.02%

最大资产回撤值(按Bar收盘计算)

回撤值	(2520.00)
发生时间	2018/05/08 09:00
回撤值/前期高点	0.03%
净利润/回撤值	674.60%

最大资产回撤值比率(按Bar收盘计算)

回撤值	(2520.00)
发生时间	2018/05/08 09:00
回撤值/前期高点	0.03%
净利润/回撤值	674.60%



交易次数



盈 亏

盈亏率=（收入-成本）/成本X 100%



胜率、 、

盈利次数/总次数



回 撤

一段趋势单向运行后到达极值，随后的反向拉回在这段趋势中所占的比率

交易汇总	交易分析	交易记录	平仓分析	阶段总结	资产变化	图表分析	系统设置						
16	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/02/15 23:00	649.5	2016/02/17 14:00	655.5	1	10.00	590.00	(1960.00)	9.08%	(24.07%)
17	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/02/18 21:00	658.0	2016/02/23 13:00	686.0	1	10.00	2790.00	830.00	42.40%	18.33%
18	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/02/23 22:00	697.5	2016/02/25 21:00	702.0	1	10.00	440.00	1270.00	6.31%	24.64%
19	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/02/29 10:00	698.5	2016/03/01 13:00	705.0	1	10.00	640.00	1910.00	9.16%	33.80%
20	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/03/01 14:00	716.0	2016/03/01 23:00	707.0	1	10.00	(910.00)	1000.00	(12.71%)	21.10%
21	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/03/02 22:00	712.0	2016/03/03 10:00	708.0	1	10.00	(410.00)	590.00	(5.76%)	15.34%
22	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/03/04 22:00	726.5	2016/03/08 13:00	739.0	1	10.00	1240.00	1830.00	17.07%	32.41%
23	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/03/10 21:00	732.5	2016/03/11 22:00	738.5	1	10.00	590.00	2420.00	8.05%	40.46%
24	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/03/14 09:00	743.0	2016/03/14 23:00	749.5	1	10.00	640.00	3060.00	8.61%	49.07%
25	rSetoEMACrossove	多头	j9888	2016/03/16 23:00	758.5	2016/03/21 21:00	766.5	1	10.00	790.00	3850.00	10.42%	59.49%

交易分析

统计指标	全部交易	盈利交易	亏损交易
交易手数	192	91	101
平均利润	649.64	3831.76	(2217.43)
平均持仓周期	10	14	6

盈亏分析

统计指标	盈利	亏损
平均浮动盈亏	4168.59	(1796.72)
最大单次浮动盈亏	25490.00	(10710.00)
发生时间	2016/11/08 13:00	2017/10/20 23:00
最大交易盈亏	20390.00	(9960.00)
最大交易盈亏/总盈亏	5.85%	4.45%
最大连续盈亏	24160.00	(26620.00)
最大连续盈亏/总盈亏	6.93%	11.89%

连续盈亏分析

连续盈利手数	出现次数	平均盈利	下一笔平均亏损
1	27	4299.26	(2121.11)
2	6	4606.67	(2493.33)
3	6	3167.78	(1543.33)
4	6	4204.58	(2718.33)
5	2	1940.00	(1535.00)

连续亏损手数	出现次数	平均亏损	下一笔平均盈利
1	24	(2178.75)	3892.17
2	12	(2351.67)	5419.17
3	6	(1998.89)	1606.67
4	3	(2197.50)	8873.33
7	2	(2445.71)	2165.00
9	1	(2071.11)	340.00

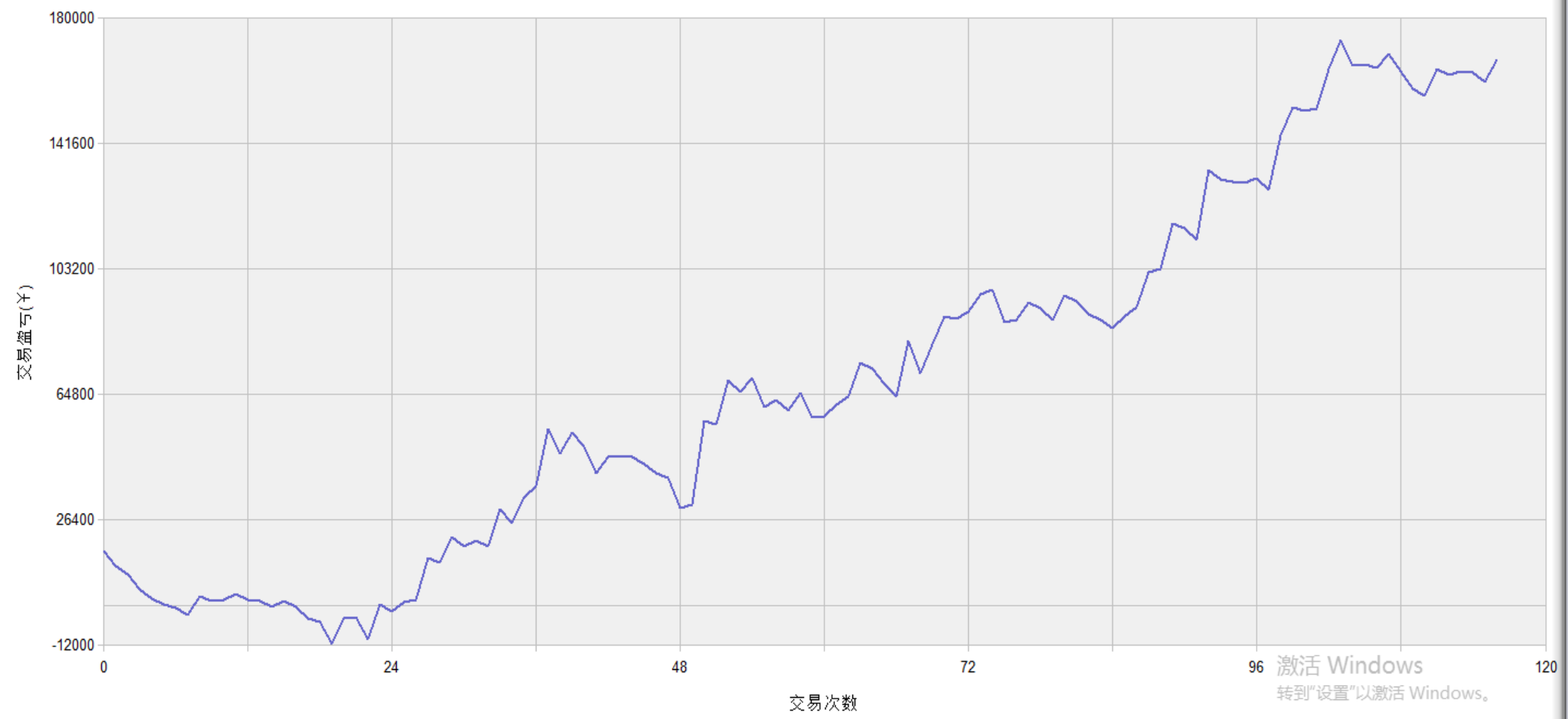
平仓分析												
#	公式应用	类型	商品	建仓时间	建仓价格	平仓时间	平仓价格	数量	最佳平仓价	最佳平仓时间	最差平仓价	最差平仓时间
1	3etoEMACrossov	多头	j9888	2015/11/23 13:00	685.0	2015/11/25 22:00	629.5	1	704.5	2015/11/25 11:00	620.0	2015/11/25 21:00
2	3etoEMACrossov	多头	j9888	2015/12/02 09:00	625.0	2015/12/03 10:00	620.5	1	630.0	2015/12/02 10:00	618.0	2015/12/03 09:00
3	3etoEMACrossov	多头	j9888	2015/12/11 23:00	610.0	2015/12/15 13:00	615.5	1	623.5	2015/12/15 09:00	607.0	2015/12/14 09:00
4	3etoEMACrossov	多头	j9888	2015/12/16 10:00	620.0	2015/12/17 22:00	619.0	1	627.5	2015/12/17 09:00	616.0	2015/12/16 13:00
5	3etoEMACrossov	多头	j9888	2015/12/18 11:00	624.5	2015/12/22 09:00	634.5	1	644.0	2015/12/21 14:00	624.0	2015/12/18 11:00
6	3etoEMACrossov	多头	j9888	2015/12/23 09:00	636.5	2015/12/23 13:00	635.0	1	636.5	2015/12/23 09:00	632.5	2015/12/23 10:00
7	3etoEMACrossov	多头	j9888	2015/12/29 10:00	634.5	2015/12/30 22:00	644.5	1	657.5	2015/12/30 09:00	634.5	2015/12/29 10:00
8	3etoEMACrossov	多头	j9888	2016/01/04 09:00	647.0	2016/01/04 10:00	643.5	1	647.0	2016/01/04 09:00	643.5	2016/01/04 09:00
9	3etoEMACrossov	多头	j9888	2016/01/08 21:00	625.5	2016/01/08 23:00	622.5	1	625.5	2016/01/08 21:00	622.5	2016/01/08 21:00
10	3etoEMACrossov	多头	j9888	2016/01/11 13:00	626.0	2016/01/11 23:00	623.0	1	629.0	2016/01/11 14:00	622.0	2016/01/11 21:00
11	3etoEMACrossov	多头	j9888	2016/01/14 14:00	621.5	2016/01/15 22:00	628.5	1	631.5	2016/01/14 21:00	619.5	2016/01/14 21:00

年度总结					
时间区间	净利润	收益率	交易成本	最大浮盈	最大浮亏
2015年	(3770.00)	(0.04%)	70.00	1700.00	(6120.00)
2016年	83660.00	0.84%	790.00	100890.00	(1030.00)
2017年	32400.00	0.32%	800.00	48390.00	(30030.00)
2018年	12440.00	0.12%	260.00	25970.00	0.00

月度盈亏分析					
月份	平均净利润	平均收益率	平均交易成本	平均最大浮盈	平均最大浮亏
1月	(320.00)	(0.00%)	71.67	7283.33	(4033.33)
2月	7136.67	0.07%	46.67	9713.33	(5843.33)
3月	(2000.00)	(0.02%)	85.00	5450.00	(8023.33)
4月	53.33	0.00%	46.67	8940.00	(11203.33)
5月	(2623.33)	(0.03%)	53.33	5900.00	(3623.33)
6月	11230.00	0.11%	75.00	13770.00	(1965.00)
7月	11065.00	0.11%	82.50	12475.00	(2500.00)
8月	6835.00	0.07%	87.50	18150.00	(4120.00)
9月	4230.00	0.04%	45.00	10185.00	(655.00)
10月	14705.00	0.15%	47.50	23120.00	(4510.00)
11月	10326.67	0.10%	56.67	16976.67	(4163.33)
12月	(3040.00)	(0.03%)	55.00	4820.00	(4266.67)

月度总结					
时间区间	净利润	收益率	交易成本	最大浮盈	最大浮亏
2015年11月	(5560.00)	(0.06%)	10.00	1700.00	(5560.00)
2015年12月	1790.00	0.02%	60.00	2750.00	(560.00)
2016年1月	930.00	0.01%	70.00	1400.00	(1030.00)
2016年2月	5210.00	0.05%	45.00	5460.00	0.00
2016年3月	1200.00	0.01%	100.00	3640.00	(2680.00)
2016年4月	23960.00	0.24%	40.00	26520.00	0.00
2016年5月	(8560.00)	(0.09%)	55.00	240.00	(8560.00)
2016年6月	1830.00	0.02%	75.00	4500.00	(3450.00)
2016年7月	8610.00	0.09%	85.00	9080.00	(1780.00)
2016年8月	2610.00	0.03%	90.00	13620.00	(1320.00)
2016年9月	5000.00	0.05%	50.00	2000.00	(500.00)

交易盈亏曲线图



系 统





买卖模式（一致、有效）

资金管理（加减、多少）

风险控制（资源与风险）

良好心态（情绪与纪律）



工欲善其事

必先利其器

必先利其器

壬辰年 潘汝基書

必先利其器

谢
谢
聆
听

