

安洛资本 A&L; Cap

Telegram 警报复盘报告

Backtest Report: 388 Alerts Analysis

数据时间范围	2026-02-21 ~ 2026-02-26 (5 天)
总警报数	388 条
成功解析	268 条 (69.1%)
涉及币种	18 个
当前运行模式	alpha (Top 15 巨鲸)
报告生成日期	2026-02-26

一、整体准确率

方法: 对每条警报提取主要币种和方向性判断(看涨/看跌), 从 Hyperliquid 获取警报发出时刻的收盘价, 对比 1h/4h/24h 后的价格变动。

时间窗口	准确率	评价
1 小时	117/268 = 43.7%	略低于随机
4 小时	103/268 = 38.4%	较差
24 小时	114/230 = 49.6%	接近随机

二、核心发现: 看跌信号远强于看涨

方向	24h 准确率	含义
看跌 (bearish)	80/91 = 87.9%	极强! 做空/减仓信号高度可靠
看涨 (bullish)	34/139 = 24.5%	很差, 几乎可作为反向指标

关键解读:

- 巨鲸做空/减仓的行为确实能有效预判市场下跌
- 巨鲸买入/加仓并不一定预示上涨 (可能是逆势抄底被套)
- 核心时间段 2/21-2/26 恰逢 BTC 从 ~\$66K 跌至 ~\$64K 的下行市场
- 下行市场中做空信号天然占优, 需更长周期验证

三、按评分区间分析 (24h)

区间	24h 准确率	样本数	平均分
85-100 极高	14/30 = 46.7%	30	90
60-84 高	85/158 = 53.8%	158	71
40-59 中	12/29 = 41.4%	29	50
0-39 低	3/13 = 23.1%	13	35

- 60-84 分区间表现最好 (53.8%), 样本量最大
- 最高分 (85-100) 反而只有 46.7%
- 低分警报 (0-39) 准确率最低 (23.1%), 应考虑过滤

四、按币种分析 (24h)

币种	24h 准确率	样本数	评价
ETH	44/66 = 66.7%	66	最强

币种	24h 准确率	样本数	评价
HYPE	35/61 = 57.4%	61	较好
BTC	27/79 = 34.2%	79	较差
XRP	4/12 = 33.3%	12	样本少
OP	0/3 = 0.0%	3	样本极少
ARB	0/2 = 0.0%	2	样本极少

五、按意图类型分析 (24h)

意图类型	24h 准确率	样本数
避险 (risk_off)	2/3 = 66.7%	3
获利了结 (profit_taking)	34/57 = 59.6%	57
策略转变 (strategy_change)	12/21 = 57.1%	21
加仓 (accumulation)	51/100 = 51.0%	100
全平仓 (exit)	1/2 = 50.0%	2
再平衡 (rebalance)	14/47 = 29.8%	47

六、模拟收益分析

假设: 每条看涨信号做多, 每条看跌信号做空, 等权重

跟随所有信号:

时间窗口	平均收益/笔	盈利次数	累计收益
1 小时	-0.057%	117/268 (43.7%)	-15.2%
4 小时	-0.556%	103/268 (38.4%)	-149.1%
24 小时	-0.191%	114/230 (49.6%)	-44.0%

仅高分警报 (≥ 60 分):

时间窗口	平均收益/笔	盈利次数	累计收益
1 小时	-0.066%	94/222 (42.3%)	-14.6%
4 小时	-0.501%	87/222 (39.2%)	-111.1%
24 小时	+0.024%	99/188 (52.7%)	+4.5%

- 盲目跟随所有信号: 全时段亏损
- 仅 ≥ 60 分信号: 24h 微利 (+4.5%)
- 最佳策略: 仅跟随看跌/做空信号 (87.9% 准确率)

七、高分警报逐条复盘 (≥85 分)

[2026-02-23 09:40] ETH | 分数: 100 | 看涨

入场价: \$1,917.20 | 4h: +0.20% | 24h: -4.75%
巨鲸0x6c85再度加仓5,000枚ETH, 多头推升至\$1亿规模

[2026-02-23 14:15] ETH | 分数: 100 | 看跌

入场价: \$1,906.20 | 4h: -2.59% | 24h: -3.80%
\$1,154万巨鲸执行历史最大单笔ETH空头平仓

[2026-02-23 19:46] BTC | 分数: 98 | 看涨

入场价: \$64,270 | 4h: +0.56% | 24h: +0.21%
重大反转——巨鲸0xc6ac全额平仓150枚BTC空头

[2026-02-23 13:02] BTC | 分数: 97 | 看涨

入场价: \$66,096 | 4h: -2.00% | 24h: -4.86%
\$3550万巨鲸单次增持83.8枚BTC多头

[2026-02-24 07:07] ETH | 分数: 97 | 看涨

入场价: \$1,824.60 | 4h: +0.09% | 24h: +3.72%
重大方向反转——scalper 0x31de BTC翻空

[2026-02-23 17:20] BTC | 分数: 95 | 看跌

入场价: \$64,777 | 4h: -0.34% | 24h: -0.91%
短线交易者BTC空头三倍加仓至99.7 BTC

[2026-02-25 01:16] BTC | 分数: 93 | 看涨

入场价: \$65,865 | 4h: -1.54% | 24h: +3.56%
0xbb47将BTC多头全额平仓并反手开空

[2026-02-23 15:25] ETH | 分数: 93 | 看涨

入场价: \$1,895.20 | 4h: -2.05% | 24h: -2.56%
1160万美元巨鲸重新翻空

[2026-02-23 18:49] HYPE | 分数: 93 | 看涨

入场价: \$26.43 | 4h: -1.00% | 24h: +1.82%
3400万美元巨鲸完成BTC方向性翻转

[2026-02-23 10:32] BTC | 分数: 92 | 看涨

入场价: \$66,290 | 4h: -0.60% | 24h: -4.58%
570万美元短线交易者BTC空头全平反手做多

[2026-02-23 14:48] ETH | 分数: 92 | 看涨

入场价: \$1,906.20 | 4h: -2.59% | 24h: -3.80%
巨鲸0x0911大幅加仓BTC多头至132.87枚

[2026-02-23 17:59] HYPE | 分数: 90 | 看涨

入场价: \$26.10 | 4h: +1.20% | 24h: +2.82%
\$1390万量化账户执行关键ETH方向性反转

[2026-02-23 18:24] HYPE | 分数: 90 | 看涨

入场价: \$26.43 | 4h: -1.00% | 24h: +1.82%
3400万巨鲸持续大幅减持BTC多头

[2026-02-23 12:45] BTC | 分数: 88 | 看涨

入场价: \$66,235 | 4h: -1.38% | 24h: -4.97%
巨鲸0xc6ac激进减仓BTC多头52%

[2026-02-23 13:48] BTC | 分数: 88 | 看涨

入场价: \$66,096 | 4h: -2.00% | 24h: -4.86%

巨鲸0xc6ac第二轮BTC多头大幅减仓

[2026-02-23 20:25] BTC | 分数: 87 | 看涨

入场价: \$64,450 | 4h: +0.73% | 24h: -0.03%

3450万巨鲸持续加速BTC空头回补

[2026-02-23 13:58] ETH | 分数: 87 | 看跌

入场价: \$1,921.00 | 4h: -3.01% | 24h: -5.53%

\$1,154万巨鲸持续系统性平仓ETH空头

[2026-02-24 22:42] ETH | 分数: 87 | 看涨

入场价: \$1,859.50 | 4h: +3.25% | 24h: +11.99%

大户0x31de完成BTC从空转多重重大翻转

八、系统三种分析模式

当前运行模式: alpha (仅监控 Top 15 盈利巨鲸)

模式	说明
realtime	实时模式(默认)。每5分钟轮询所有地址，变动即分析。最全面但消耗最多AI tokens。
batch_1h	批量模式。每小时批量分析，除非检测到突破性事件才实时分析。节省AI成本。
alpha	Alpha模式。仅监控盈利能力Top 15巨鲸，推送阈值动态调整。信号质量最高。

九、复盘结论与优化建议

核心结论:

- 看跌信号是真正的 alpha — 87.9% 的 24h 准确率
- 看涨信号需极度谨慎 — 24.5% 准确率，低于随机水平
- ETH 和 HYPE 信号质量最高 (66.7%, 57.4%)
- 获利了结和策略转变最有参考价值 (59.6%, 57.1%)
- 60-84 分区间性价比最高 (53.8%)

优化建议:

- A. 方向性过滤: 看跌信号降低门槛(≥ 60)，看涨信号提高门槛(≥ 90)
- B. 币种差异化: ETH/HYPE 权重上调，BTC 要求更高分数
- C. 意图过滤: 重点推送 profit_taking/strategy_change，降低 rebalance 权重
- D. 市场环境适配: 需更长周期(30天+)验证，当前仅5天下行市场
- E. 复合信号: 多个巨鲸同方向操作 = 强化信号

局限性:

- 样本期仅 5 天，统计意义有限
- 处于单边下行市场，做空天然占优
- 120 条警报无法解析，存在选择偏差
- 未考虑交易成本和滑点
- 方向性判断依赖规则提取，可能存在误分类