Rolling Performance Analysis - Strategy Robustness Over Time Rolling Sharpe Ratio (252 days) Rolling Volatility (252 days) Equal Weight (Monthly) Equal Weight (Monthly) Inverse Vol Inverse Vol Min Variance Min Variance Momentum Momentum TD3_Strategy TD3_Strategy 20.0 3 Wunnalized Volatility (%) 17.5 15.0 15.5 Sharpe Ratio 10.0 7.5 2017-01 2017-05 2017-09 2018-01 2018-05 2018-09 2019-01 2019-05 2019-09 2020-01 2018-01 2018-05 2018-09 2019-01 2019-05 2019-09 2020-01 2017-01 2017-05 2017-09 Rolling Maximum Drawdown (252 days) Rolling Sortino Ratio (252 days) Equal Weight (Monthly) Equal Weight (Monthly) Inverse Vol Inverse Vol 35 Min Variance Min Variance Momentum Momentum TD3_Strategy TD3_Strategy 30 Max Drawdown (%) 20 15 Sortino Ratio 10 2017-01 2017-05 2017-09 2018-01 2018-05 2018-09 2019-01 2019-05 2019-09 2020-01 2017-01 2017-05 2017-09 2018-01 2018-05 2018-09 2019-01 2019-05 2019-09 2020-01

Date

Date