

策略与底层资产价格对比



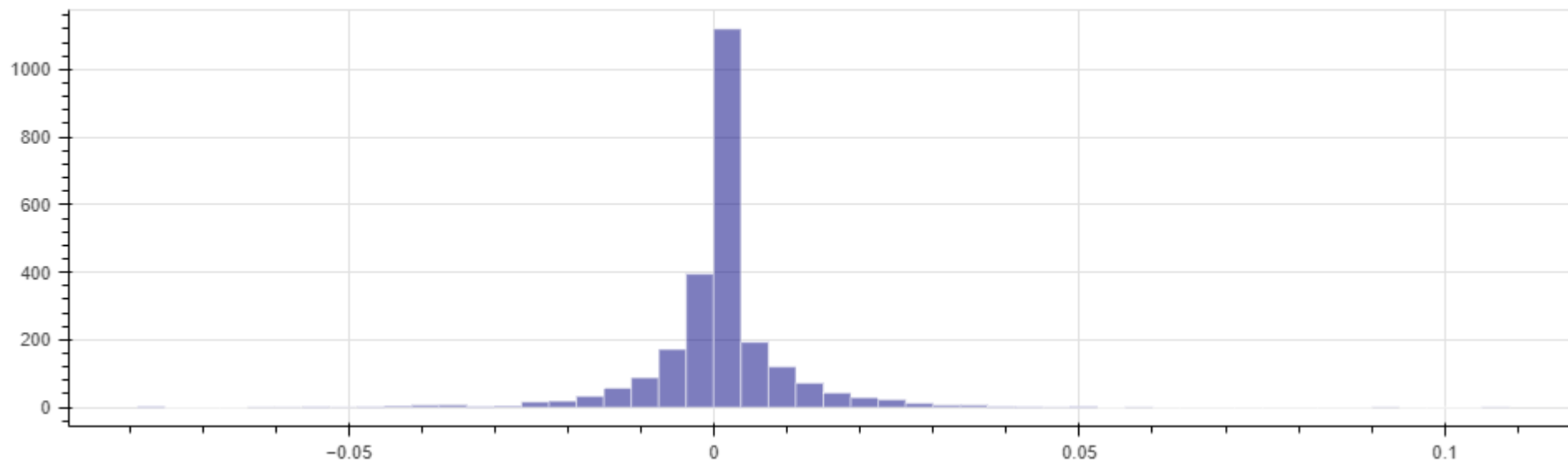
组合价值



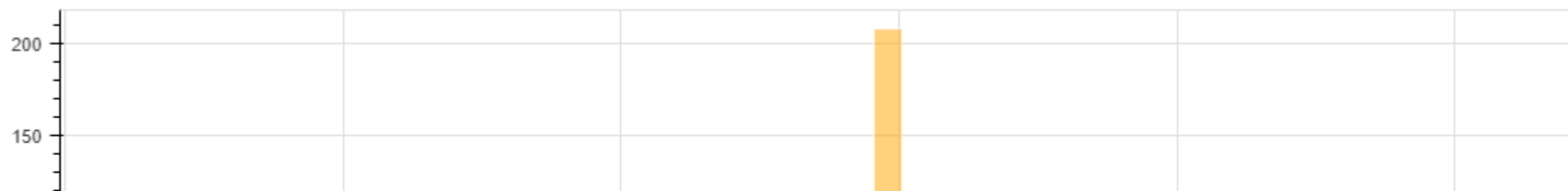
回撤

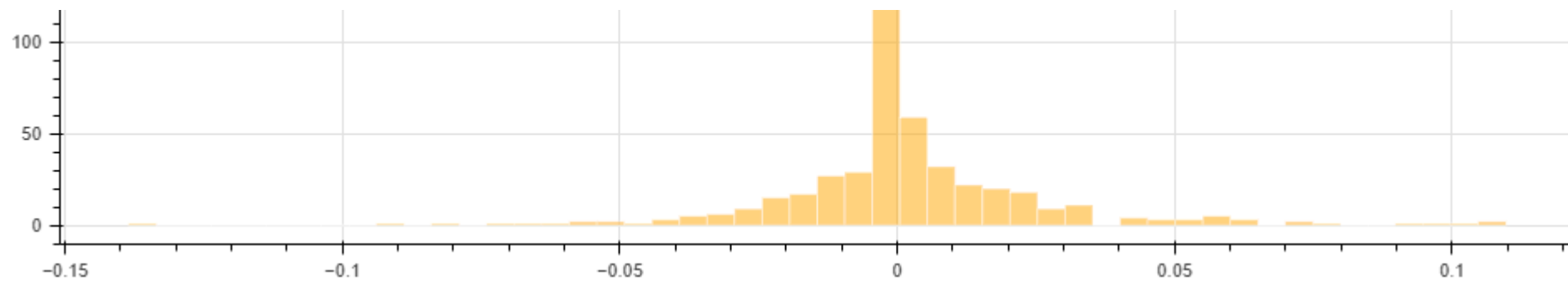


每日收益分布

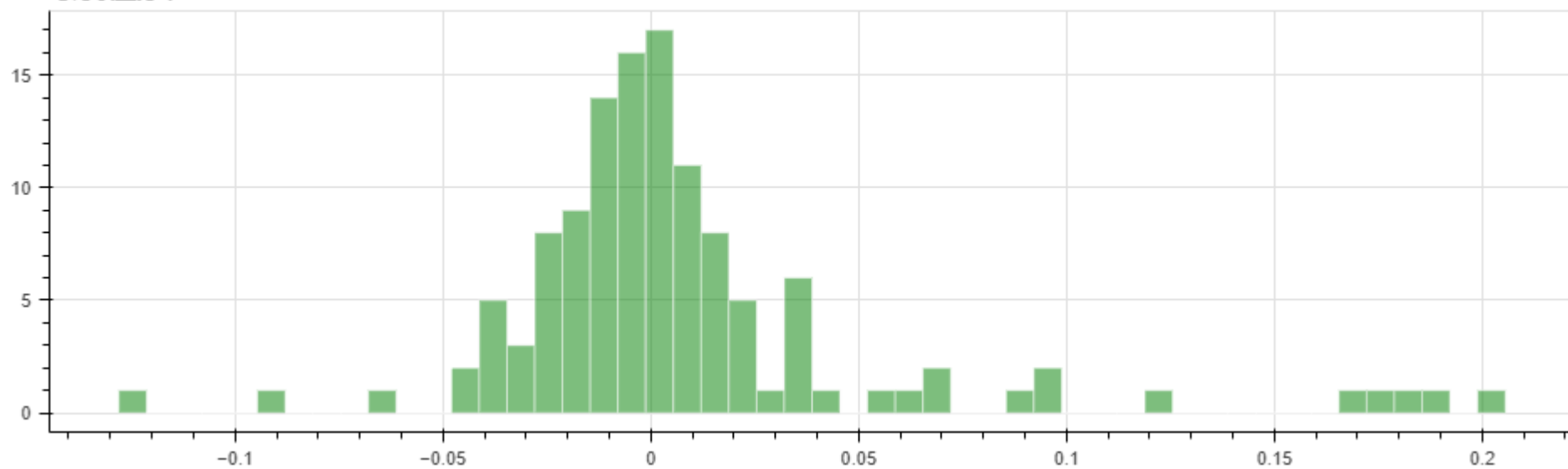


每周收益分布





每月收益分布



累计收益





策略绩效分析

总收益率:	1.3124
年化收益率:	0.0898
年化波动率:	0.1633
夏普比率:	0.5499
索提诺比率:	0.5719
卡尔马比率:	0.2397
最大回撤:	-0.3747
胜率:	0.6616
最大恢复时间:	0