

策略与底层资产价格对比



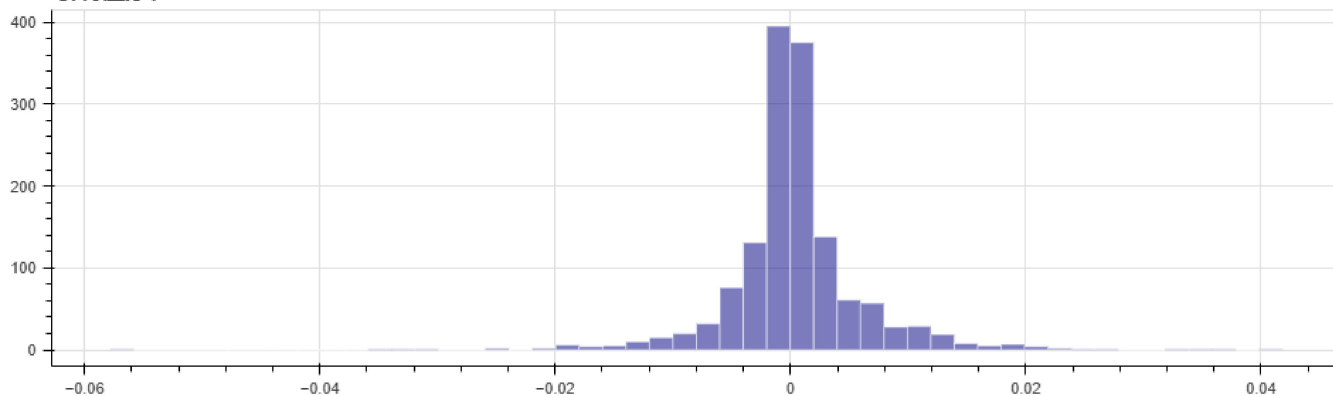
组合价值



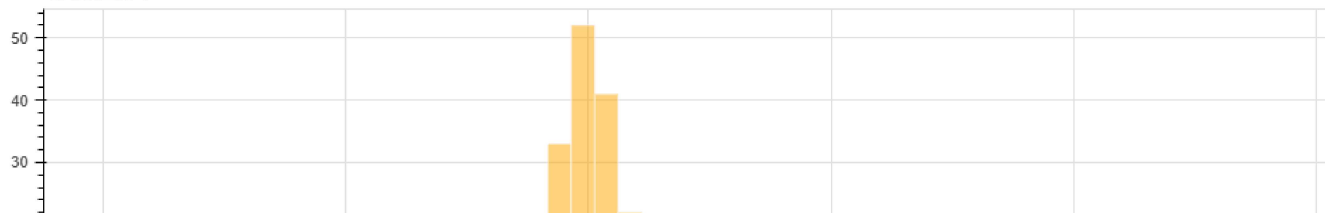
回撤

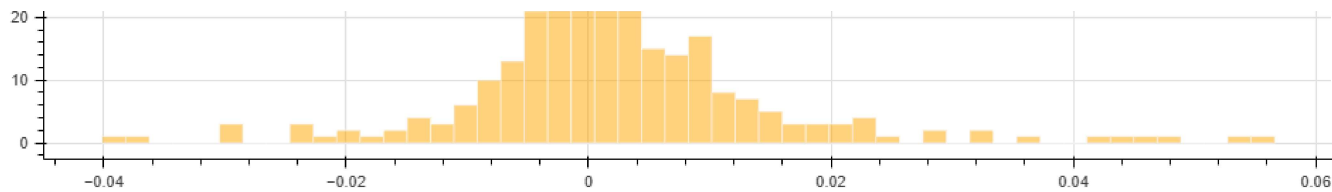


每日收益分布

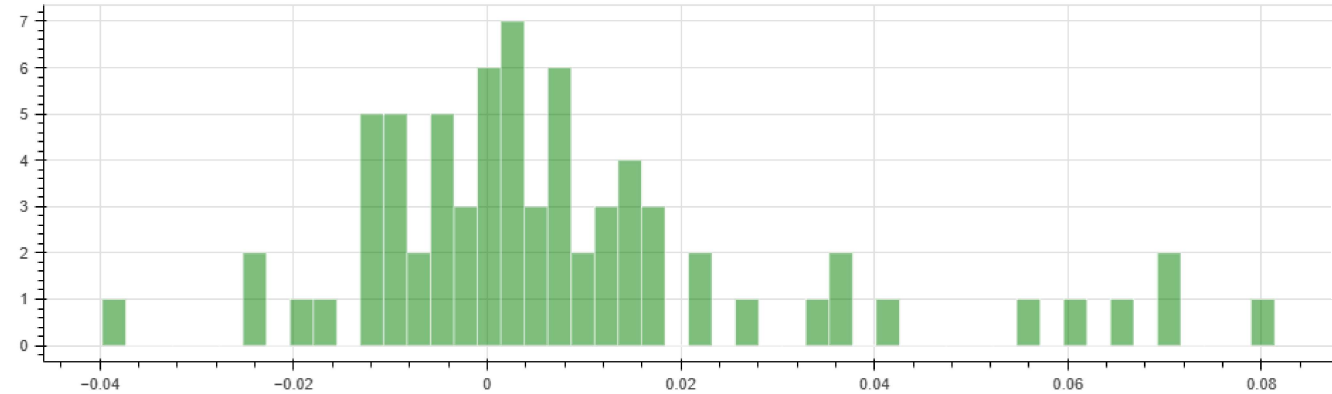


每周收益分布





每月收益分布



累计收益



### 策略绩效分析

总收益率: 0.7696

年化收益率: 0.1050

年化波动率: 0.0954

夏普比率: 1.1000

索提诺比率: 1.4012

卡尔马比率: 1.2398

最大回撤: -0.0847

胜率: 0.5101

最大恢复时间: 0