

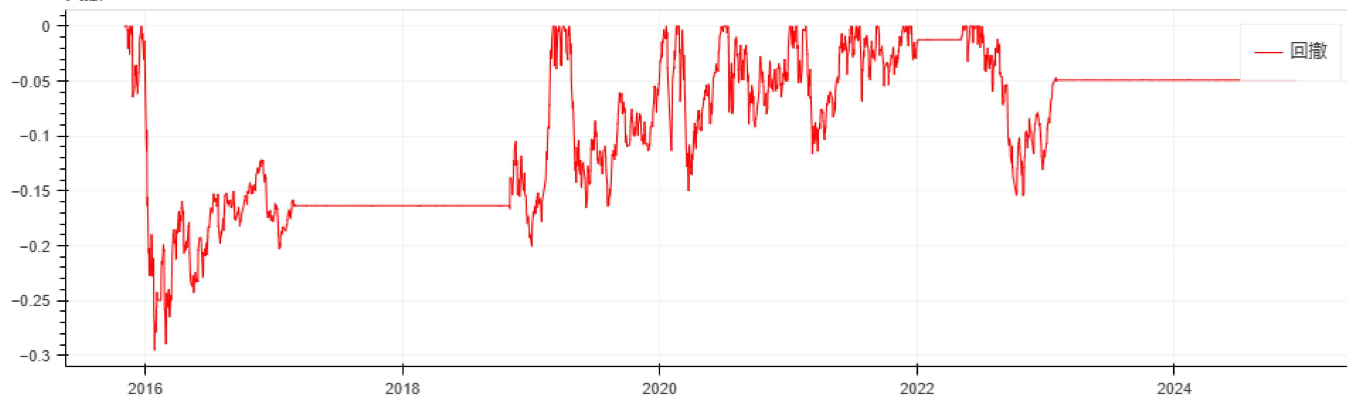
策略与底层资产价格对比



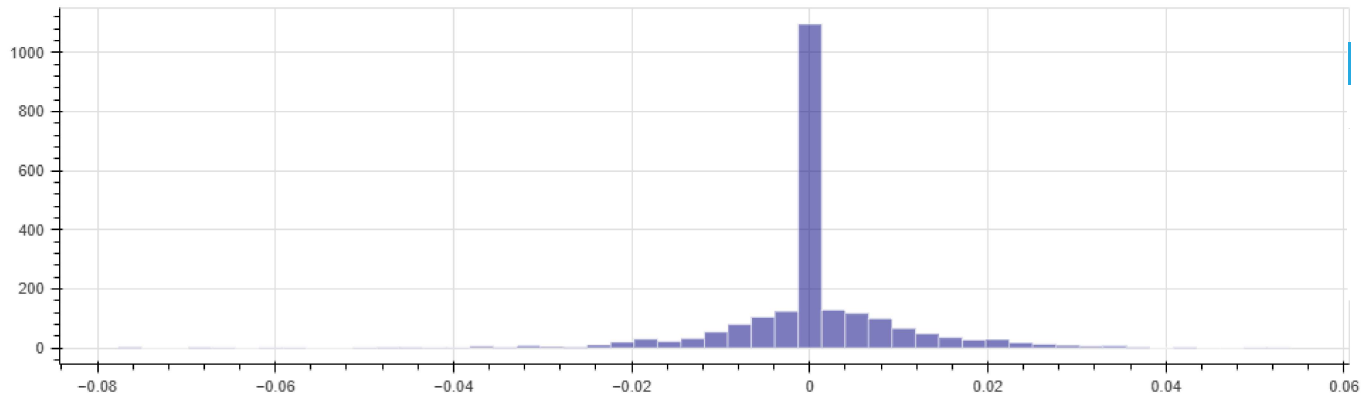
组合价值



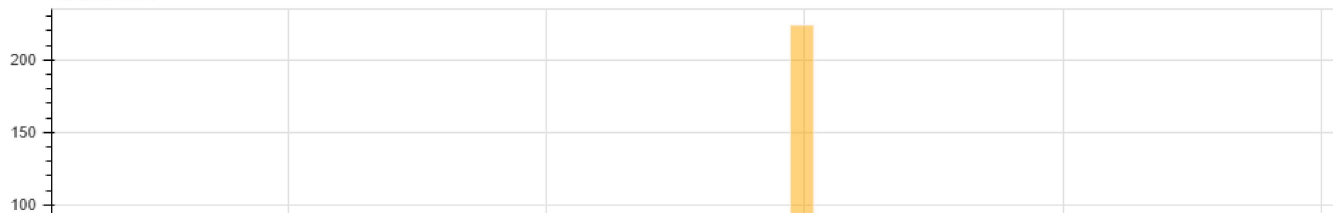
回撤

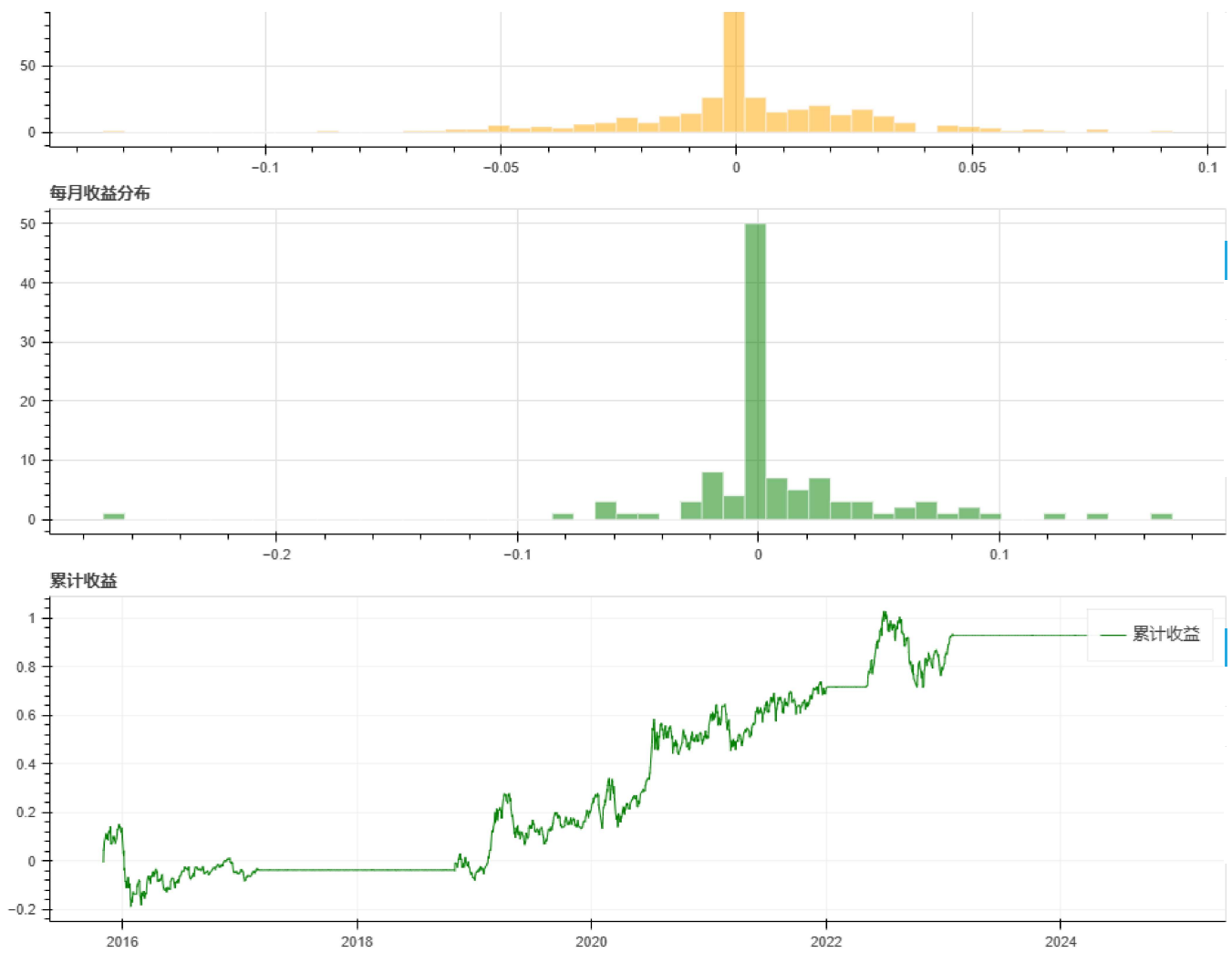


每日收益分布



每周收益分布





策略绩效分析

| | |
|---------|---------|
| 总收益率: | 0.9295 |
| 年化收益率: | 0.0775 |
| 年化波动率: | 0.1641 |
| 夏普比率: | 0.4725 |
| 索提诺比率: | 0.4414 |
| 卡尔马比率: | 0.2626 |
| 最大回撤: | -0.2952 |
| 胜率: | 0.7326 |
| 最大恢复时间: | 0 |