

策略与底层资产价格对比



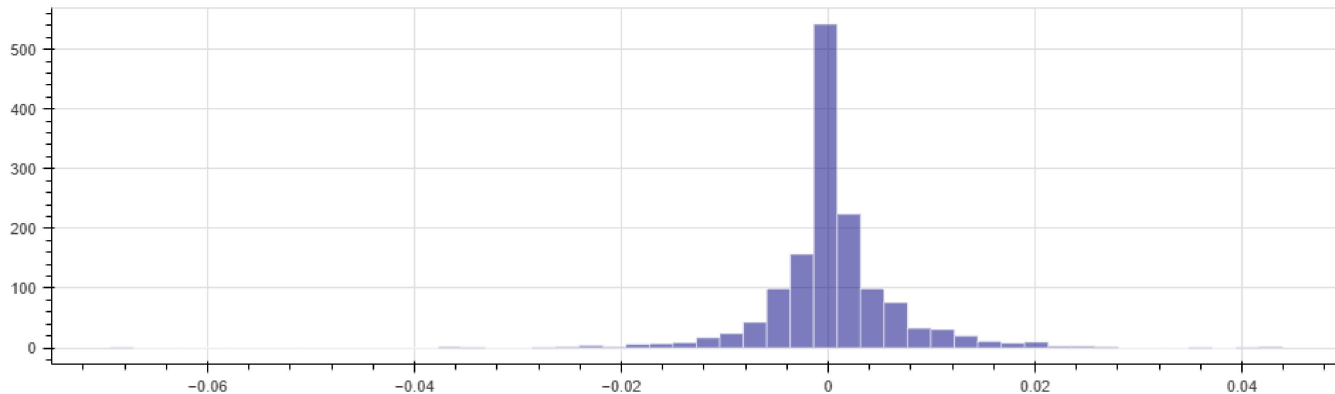
组合价值



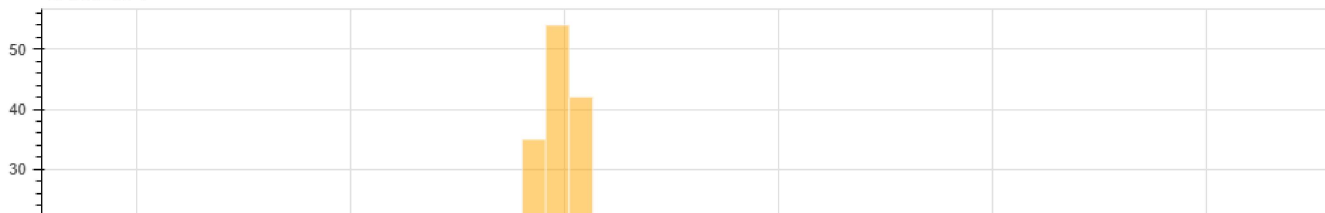
回撤

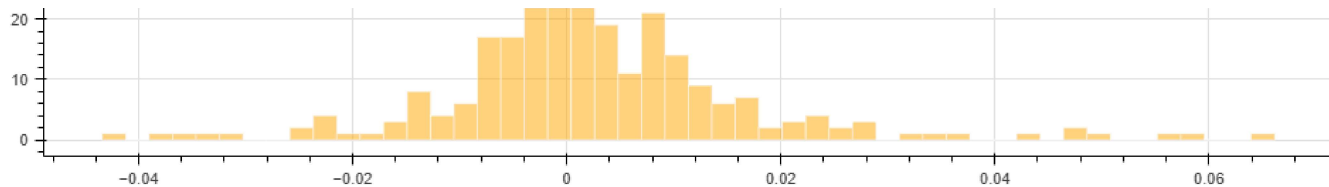


每日收益分布

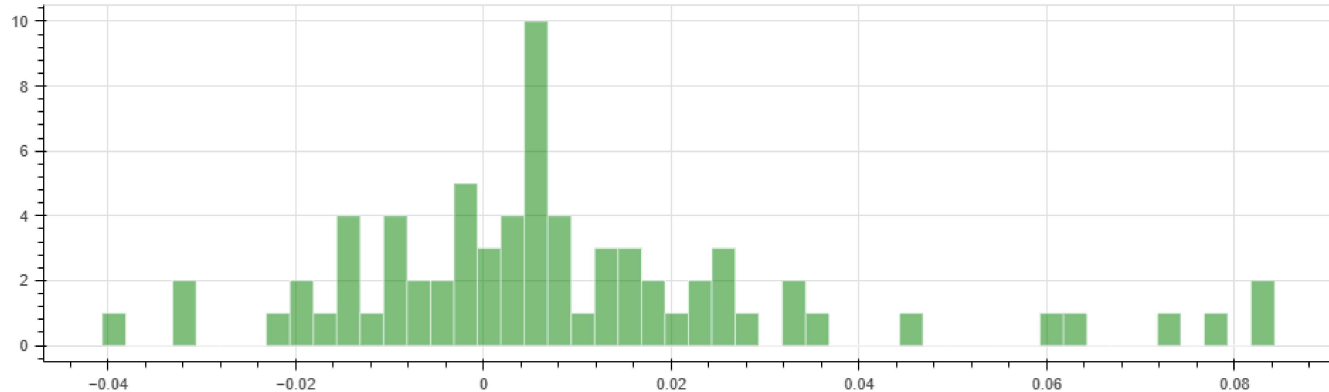


每周收益分布





每月收益分布



累计收益



#### 策略绩效分析

总收益率: 0.8733

年化收益率: 0.1160

年化波动率: 0.1071

夏普比率: 1.0836

索提诺比率: 1.3538

卡尔马比率: 1.2335

最大回撤: -0.0941

胜率: 0.5212

最大恢复时间: 0