

策略与底层资产价格对比



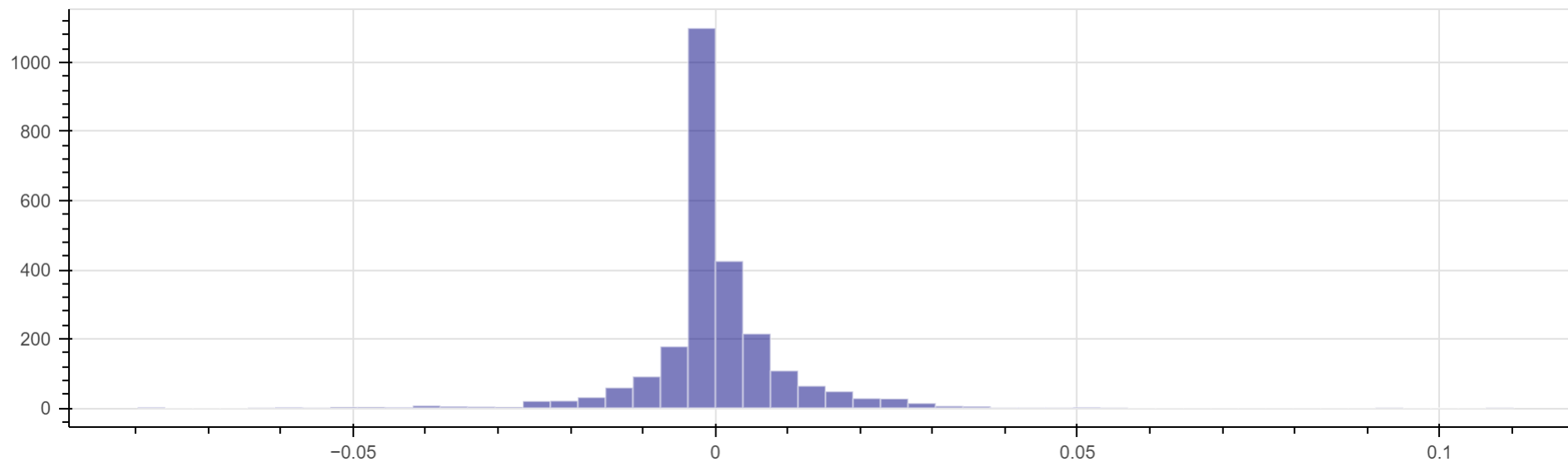
组合价值



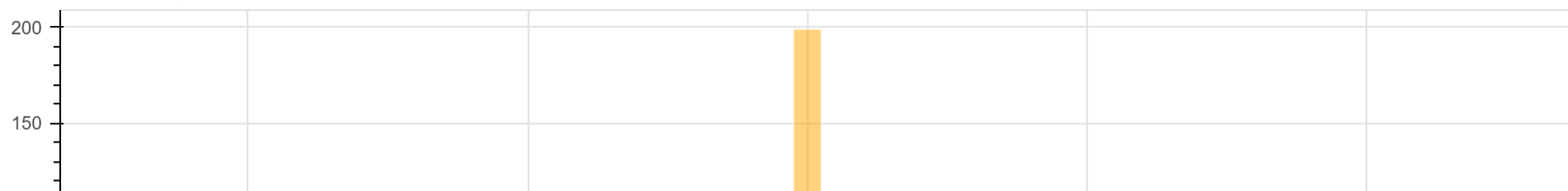
回撤

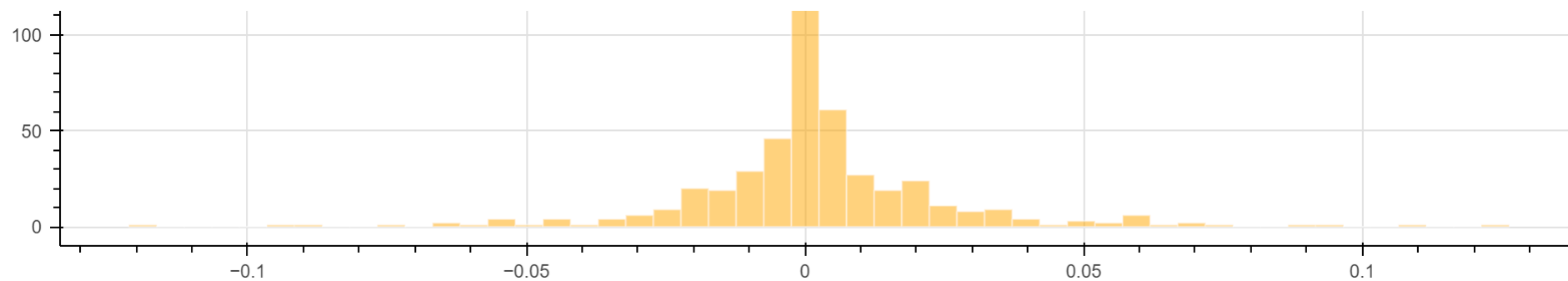


每日收益分布

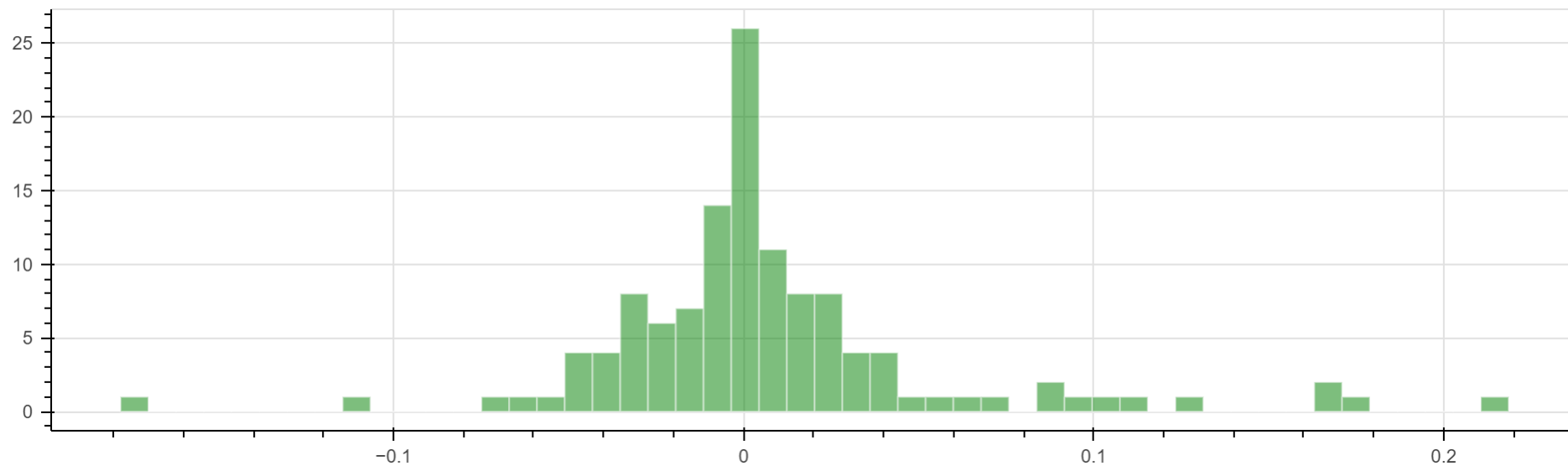


每周收益分布





每月收益分布



累计收益





策略绩效分析

总收益率:	1.1495
年化收益率:	0.0809
年化波动率:	0.1609
夏普比率:	0.5027
索提诺比率:	0.5294
卡尔马比率:	0.2040
最大回撤:	-0.3964
胜率:	0.6536
最大恢复时间:	0