

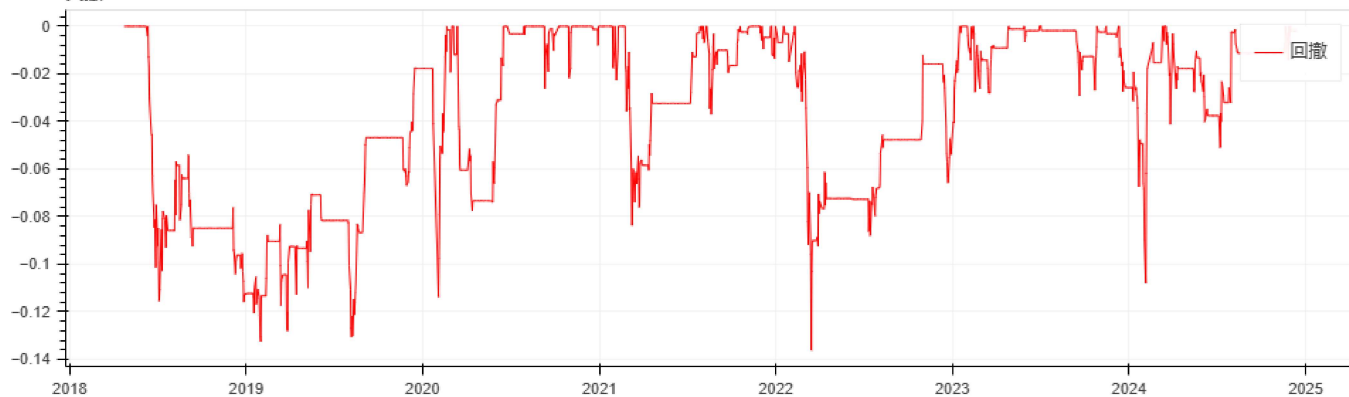
策略与底层资产价格对比



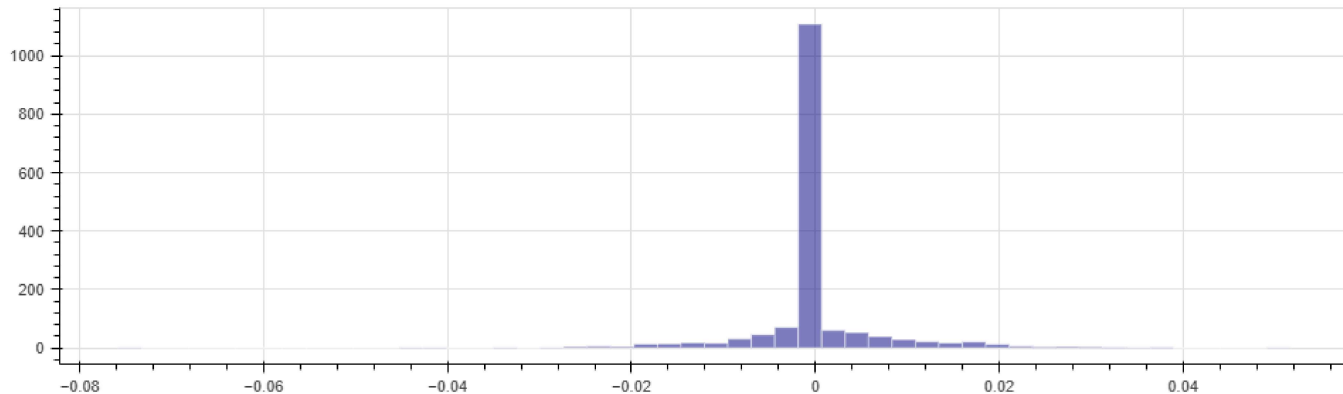
组合价值



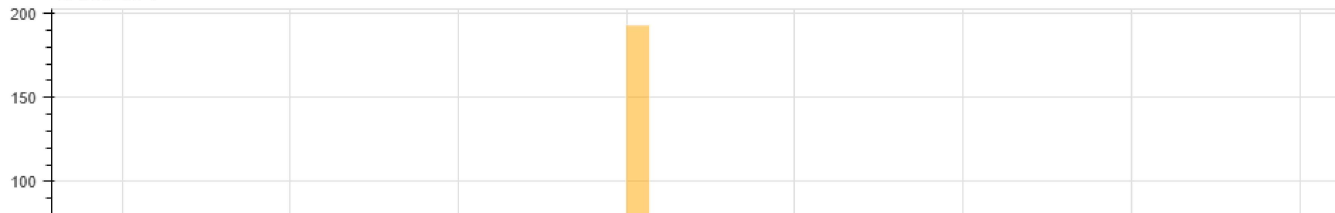
回撤

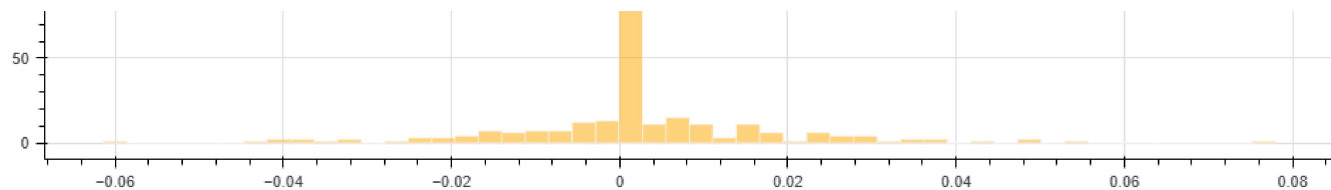


每日收益分布

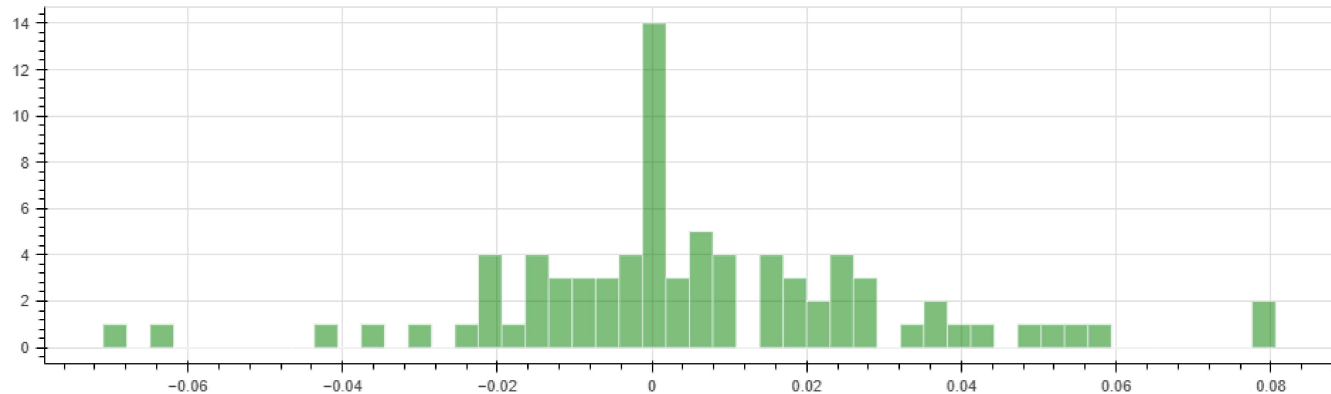


每周收益分布





每月收益分布



累计收益



### 策略绩效分析

总收益率: 0.5368

年化收益率: 0.0694

年化波动率: 0.1140

夏普比率: 0.6085

索提诺比率: 0.5215

卡尔马比率: 0.5095

最大回撤: -0.1362

胜率: 0.8228

最大恢复时间: 0