

策略与底层资产价格对比



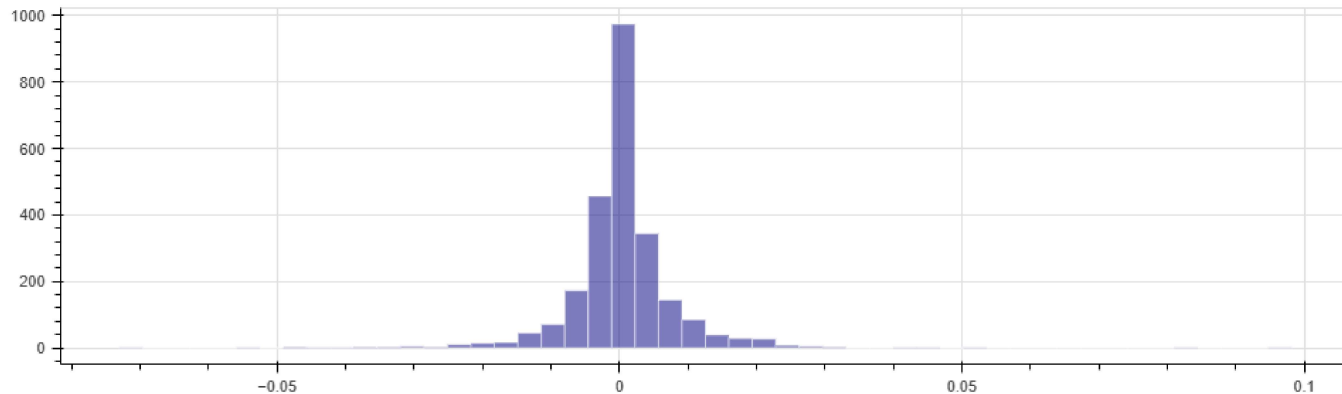
组合价值



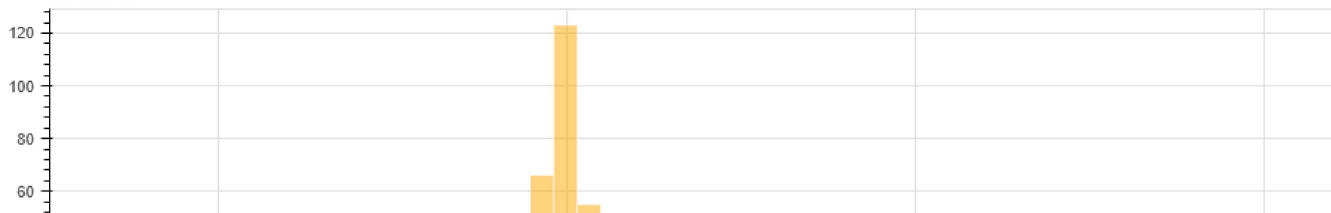
回撤

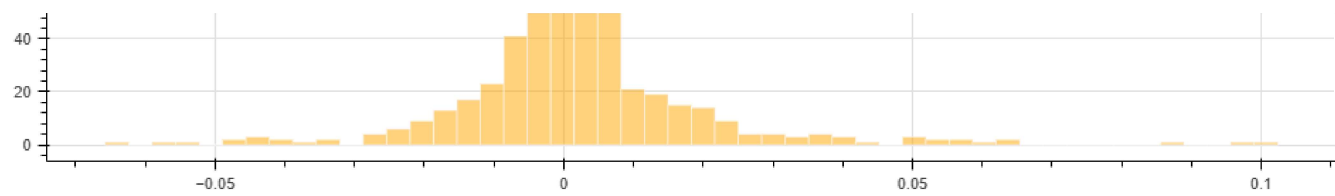


每日收益分布

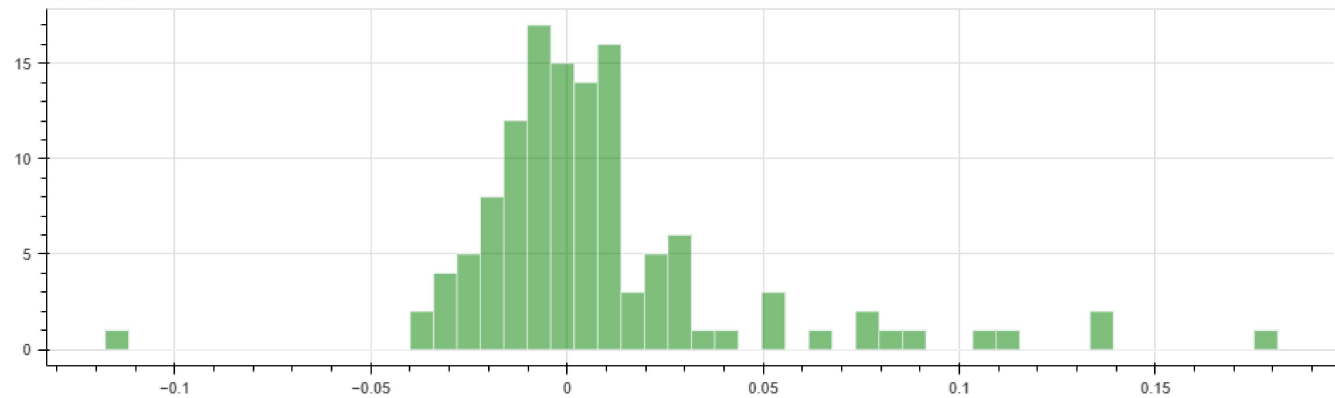


每周收益分布





每月收益分布



累计收益



策略绩效分析

总收益率:	1.3833
年化收益率:	0.0926
年化波动率:	0.1273
夏普比率:	0.7277
索提诺比率:	0.9042
卡尔马比率:	0.4295
最大回撤:	-0.2156
胜率:	0.5330
最大恢复时间:	0