

策略与底层资产价格对比



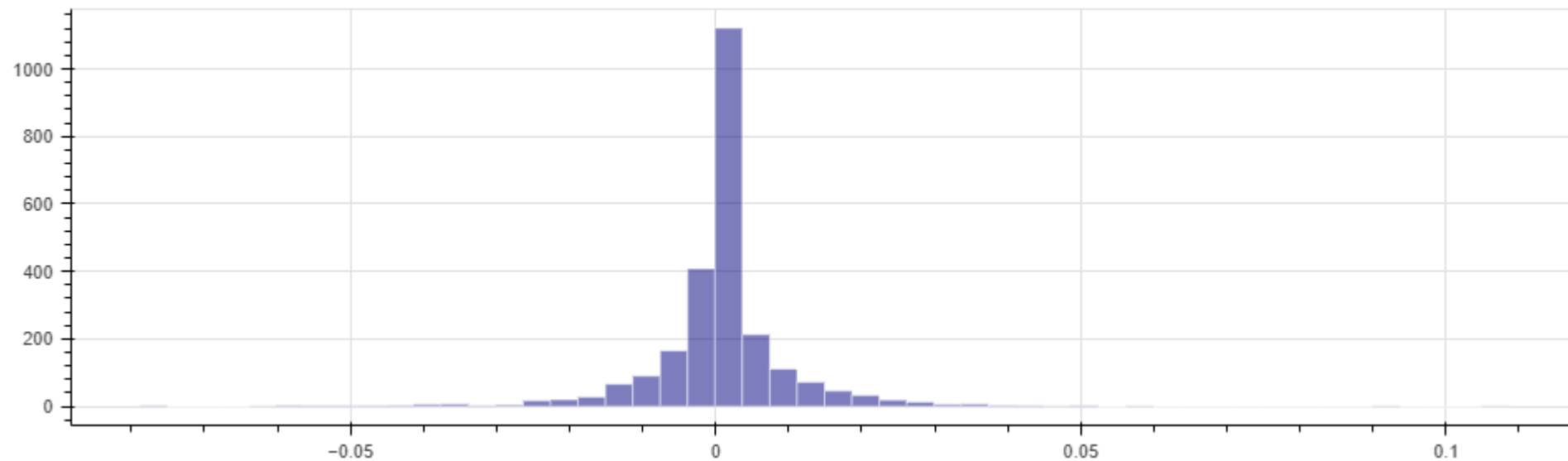
组合价值



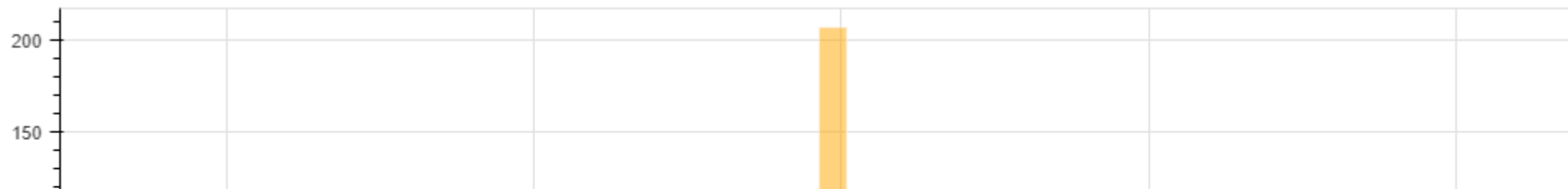
回撤

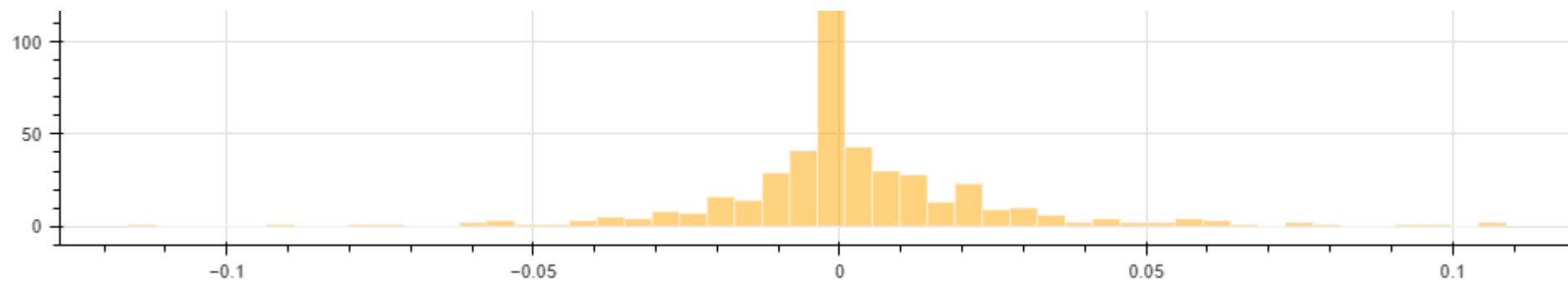


每日收益分布

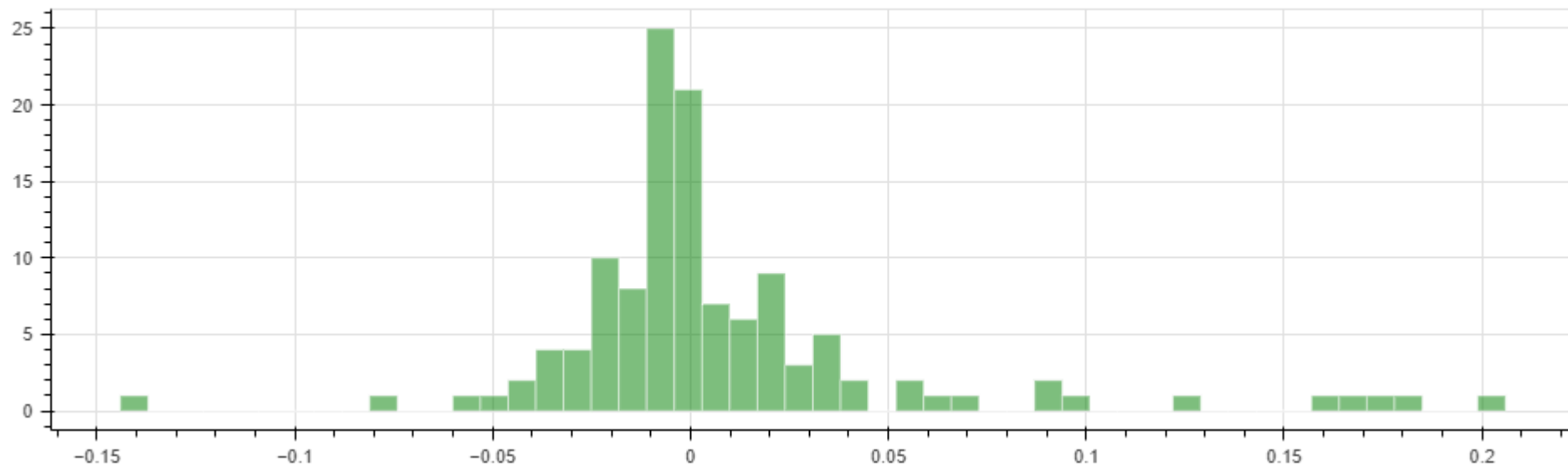


每周收益分布





每月收益分布



累计收益





策略绩效分析

总收益率: 1.2890

年化收益率: 0.0877

年化波动率: 0.1602

夏普比率: 0.5476

索提诺比率: 0.5709

卡尔马比率: 0.2454

最大回撤: -0.3576

胜率: 0.6602

最大恢复时间: 0