回测报告

# 策略表现

年化收益: 0.6478

策略累计收益: 2.6357

基准累计收益: 1.6484

策略最大回撤: -0.3020

最大回撤发生时间段: 2015-06-12 00:00:00 至 2015-07-08 00:00:00

阿尔法收益: 0.3540

夏普比率: 2.0287

# 图形展示

