

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0552, 标准差: 0.3180, 置信区间: (-0.2984242156814876, 0.1231026170511611)
- 夏普比率的均值: -0.0257, 标准差: 1.3804, 置信区间: (-2.648052036719753, 0.7996707808193825)
- 最大回撤的均值: -0.1756, 标准差: 0.0931, 置信区间: (-0.5456496567002768, -0.11557801669039058)
- 年化波动率的均值: 0.1600, 标准差: 0.0693, 置信区间: (0.07478328320522058, 0.23856266140138951)
- 索提诺比率的均值: 0.0758, 标准差: 1.3323, 置信区间: (-1.931279741194474, 0.9077193837186582)
- 卡玛比率的均值: -0.0094, 标准差: 1.0014, 置信区间: (-1.4178481846872681, 0.8001537819868265)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5159
- 夏普比率大于1的概率: 0.1198
- 索提诺比率大于1的概率: 0.1656
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.0956





