

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0392, 标准差: 0.2802, 置信区间: (-0.29955867123604774, 0.11609348686767929)
- 夏普比率均值: -0.1380, 标准差: 1.4002, 置信区间: (-3.1088317851815326, 0.6864299113314929)
- 最大回撤均值: -0.1615, 标准差: 0.0960, 置信区间: (-0.5502863715680177, -0.09427036663177846)
- 年化波动率均值: 0.1432, 标准差: 0.0623, 置信区间: (0.0630065455941519, 0.20070877288960257)
- 索提诺比率的均值: -0.0571, 标准差: 1.3923, 置信区间: (-2.442779123102624, 0.7604337103730945)
- 卡玛比率的均值: -0.0635, 标准差: 0.9668, 置信区间: (-1.4151472984504212, 0.7493068743825516)
- 年化收益率大于0的概率: 0.4958
- 夏普比率大于1的概率: 0.1287
- 索提诺比率大于1的概率: 0.1431
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.2821



