

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0156, 标准差: 0.1970, 置信区间: (-0.5711272641498101, 0.10121687429422432)
- 夏普比率的均值: -0.1789, 标准差: 1.0665, 置信区间: (-2.1380081085388714, 0.7268339019157641)
- 最大回撤的均值: -0.1558, 标准差: 0.1166, 置信区间: (-0.5721041261577551, -0.06997594808403551)
- 年化波动率的均值: 0.1458, 标准差: 0.0891, 置信区间: (0.02949119264109128, 0.223444255420018)
- 索提诺比率的均值: -0.0272, 标准差: 1.0397, 置信区间: (-1.7850186271446569, 0.8739191108480727)
- 卡玛比率的均值: -0.0881, 标准差: 0.9167, 置信区间: (-1.3959702279067094, 0.8045231031987802)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5038
- 夏普比率大于1的概率: 0.1498
- 索提诺比率大于1的概率: 0.1729
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.4101



