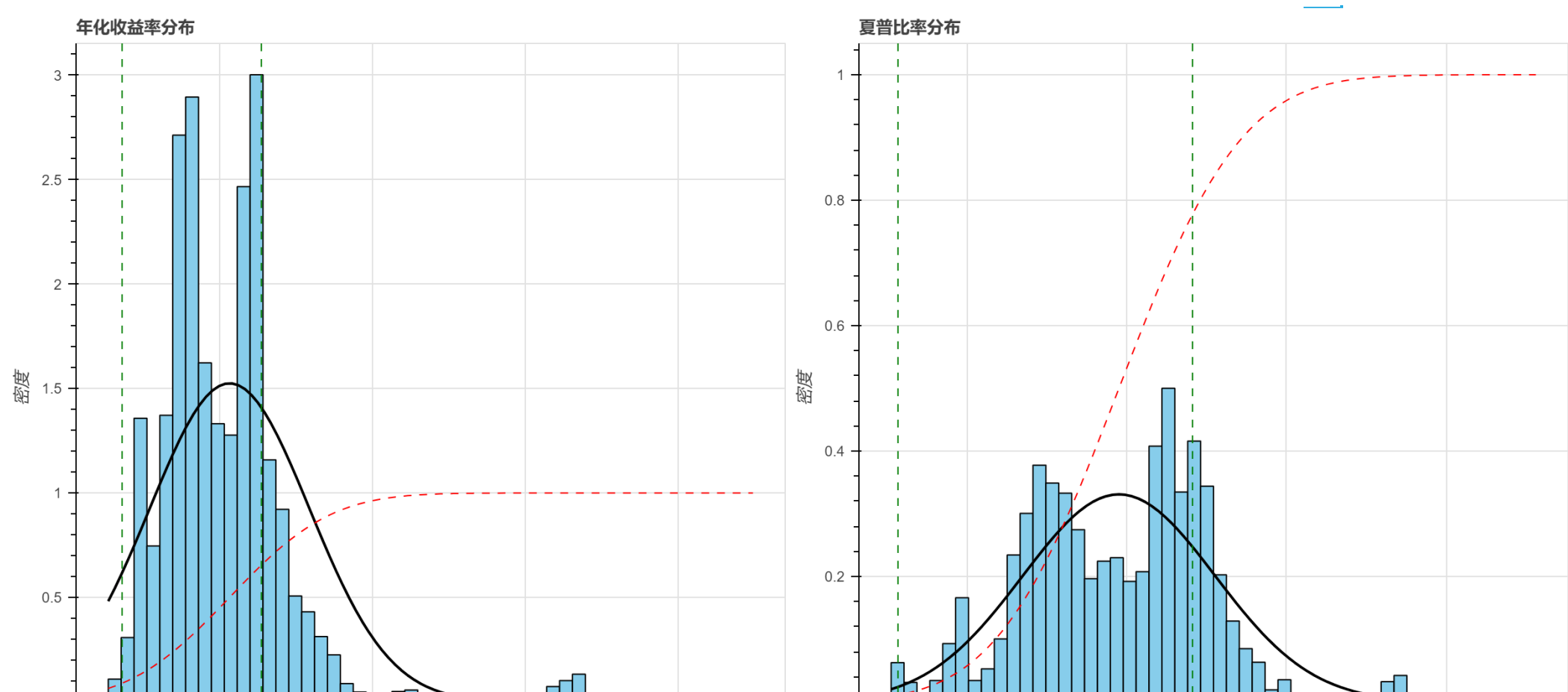
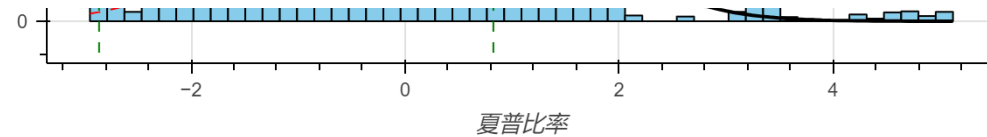
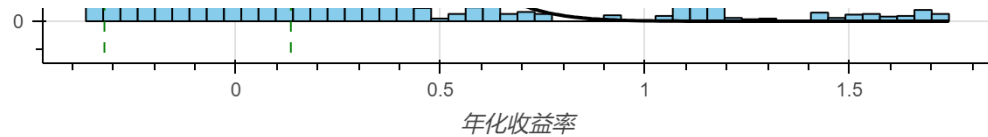


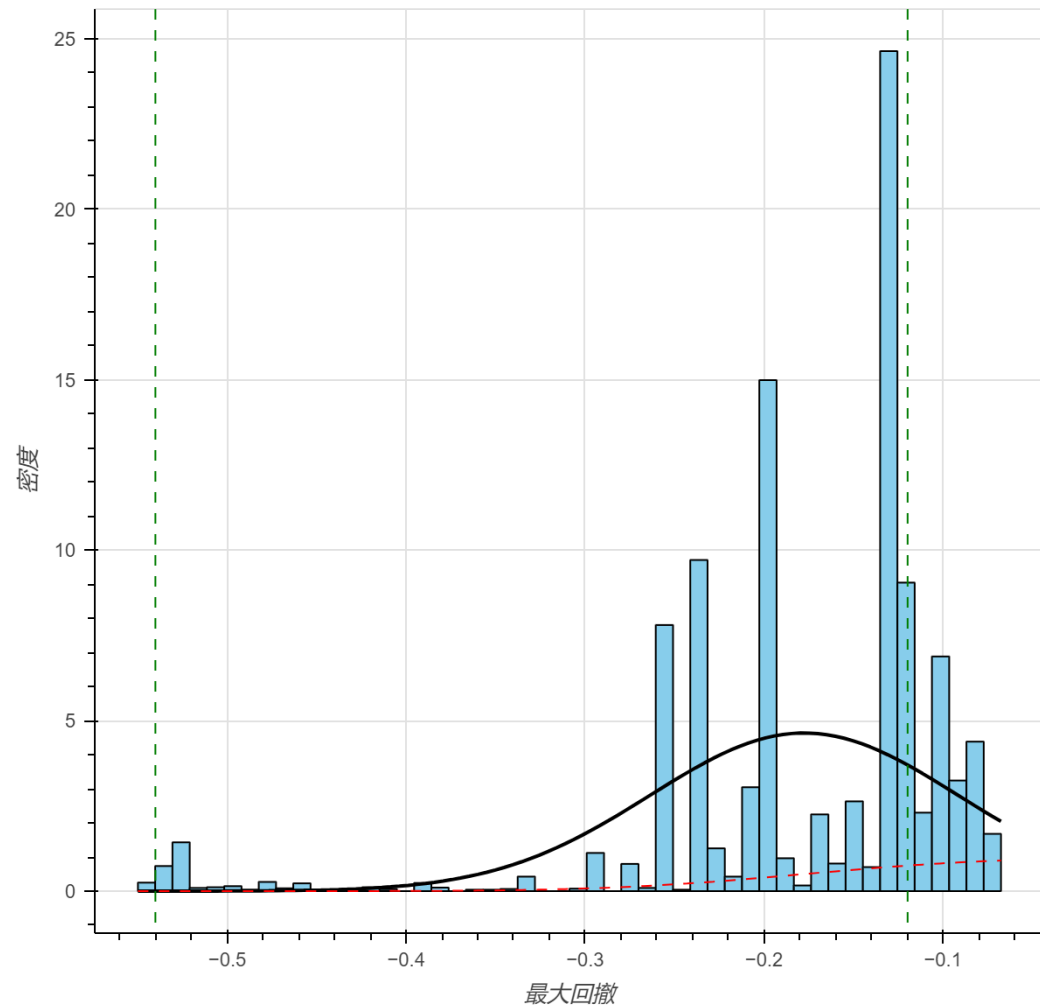
蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0306, 标准差: 0.2616, 置信区间: (-0.3212034553404577, 0.13458695457701222)
- 夏普比率的均值: -0.0943, 标准差: 1.2058, 置信区间: (-2.8595029094191116, 0.826249376132141)
- 最大回撤的均值: -0.1776, 标准差: 0.0860, 置信区间: (-0.5401584904681309, -0.11970031150062077)
- 年化波动率的均值: 0.1691, 标准差: 0.0703, 置信区间: (0.07832215571429192, 0.23054534720502284)
- 索提诺比率的均值: -0.0076, 标准差: 1.2090, 置信区间: (-2.343219133888285, 0.917970132949857)
- 卡玛比率的均值: -0.0547, 标准差: 0.9638, 置信区间: (-1.394466021218504, 0.8518760414379777)
- 年化收益率大于0的概率: 0.4891
- 夏普比率大于1的概率: 0.1399
- 索提诺比率大于1的概率: 0.1751
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1145

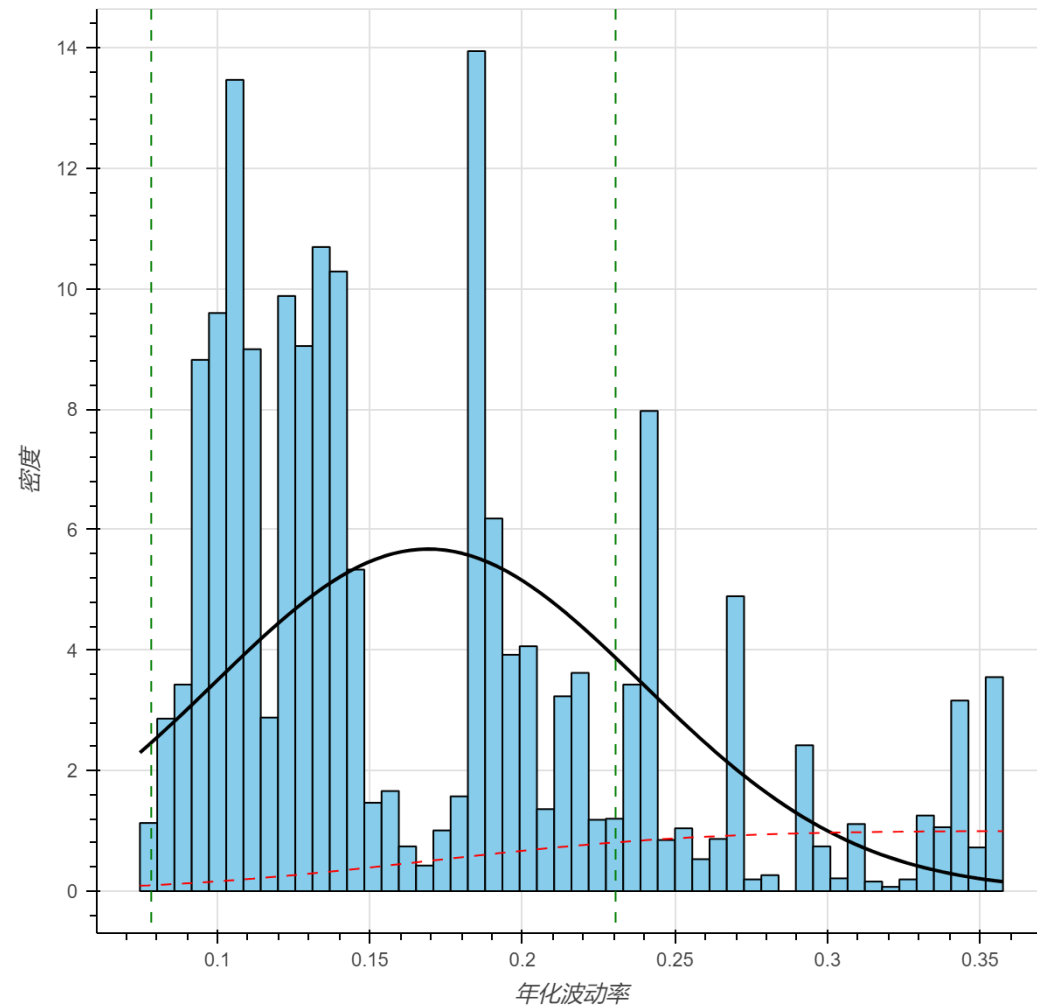




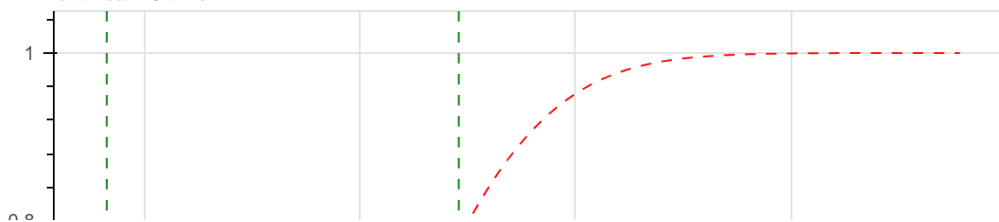
最大回撤分布



年化波动率分布



索提诺比率分布



卡玛比率分布

