

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0315, 标准差: 0.2218, 置信区间: (-0.5216191523970055, 0.13230899963536305)
- 夏普比率均值: -0.0417, 标准差: 1.1499, 置信区间: (-2.238689459383156, 0.8809678065787703)
- 最大回撤均值: -0.1609, 标准差: 0.1123, 置信区间: (-0.5721041261577551, -0.06923573707920605)
- 年化波动率均值: 0.1513, 标准差: 0.0854, 置信区间: (0.042573464057350484, 0.21923450315214243)
- 索提诺比率的均值: 0.0755, 标准差: 1.1581, 置信区间: (-2.0073984218174807, 1.0180100466909323)
- 卡玛比率的均值: 0.0281, 标准差: 0.9790, 置信区间: (-1.4314034005299499, 0.9681814000086054)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5513
- 夏普比率大于1的概率: 0.1702
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2039
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.3134



