

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0562, 标准差: 0.2522, 置信区间: (-0.2268882368478986, 0.14412787270939909)
- 夏普比率的均值: -0.0426, 标准差: 1.4540, 置信区间: (-2.5999181931725266, 0.927378889775427)
- 最大回撤的均值: -0.1353, 标准差: 0.0971, 置信区间: (-0.5190445025357703, -0.06406837094554252)
- 年化波动率的均值: 0.1127, 标准差: 0.0627, 置信区间: (0.0410901209246353, 0.176411735585378)
- 索提诺比率的均值: 0.0846, 标准差: 1.4101, 置信区间: (-2.2475130563371066, 1.0979395440472883)
- 卡玛比率的均值: -0.0500, 标准差: 0.9771, 置信区间: (-1.4297696701484586, 0.7423098448468809)
- 年化收益率大于0的概率: 0.4877
- 夏普比率大于1的概率: 0.1760
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2384
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.5699



