

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0618, 标准差: 0.2366, 置信区间: (-0.19182970419618062, 0.13932876148354878)
- 夏普比率的均值: 0.1109, 标准差: 1.0975, 置信区间: (-1.8514835779801688, 0.8338704806305134)
- 最大回撤的均值: -0.1428, 标准差: 0.0918, 置信区间: (-0.4578064401433699, -0.06985759030738992)
- 年化波动率的均值: 0.1415, 标准差: 0.0728, 置信区间: (0.05699557965570971, 0.21214459330297908)
- 索提诺比率的均值: 0.1488, 标准差: 1.1428, 置信区间: (-1.9703677560429136, 0.9272172691662889)
- 卡玛比率的均值: 0.0456, 标准差: 0.9199, 置信区间: (-1.4171795442202177, 0.7708987782490461)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5035
- 夏普比率大于1的概率: 0.1601
- 索提诺比率大于1的概率: 0.1888
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.4443





