

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0854, 标准差: 0.2405, 置信区间: (-0.30702491062885573, 0.16929518707858593)
- 夏普比率的均值: 0.3348, 标准差: 0.9932, 置信区间: (-1.8667921818993773, 1.0103676407992381)
- 最大回撤的均值: -0.1523, 标准差: 0.0999, 置信区间: (-0.5223333499790594, -0.07350134188908863)
- 年化波动率的均值: 0.1575, 标准差: 0.0800, 置信区间: (0.0627987490021695, 0.21231602061375215)
- 索提诺比率的均值: 0.3935, 标准差: 1.1592, 置信区间: (-2.144735963355384, 1.2314120103154806)
- 卡玛比率的均值: 0.3133, 标准差: 0.8930, 置信区间: (-1.3391172385187509, 1.0525224391158974)
- 年化收益率大于0的概率: 0.6422
- 夏普比率大于1的概率: 0.2074
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2746
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.3833



