

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.1076, 标准差: 0.3367, 置信区间: (-0.24315810430192275, 0.21953224871607002)
- 夏普比率的均值: 0.3048, 标准差: 1.4044, 置信区间: (-2.331652524166902, 1.1552976331477407)
- 最大回撤的均值: -0.1840, 标准差: 0.0954, 置信区间: (-0.5433000556732415, -0.1089550279668915)
- 年化波动率的均值: 0.1667, 标准差: 0.0683, 置信区间: (0.07438644983608447, 0.2310121744453828)
- 索提诺比率的均值: 0.4161, 标准差: 1.4747, 置信区间: (-2.024822672626303, 1.3103695752581241)
- 卡玛比率的均值: 0.2521, 标准差: 1.0272, 置信区间: (-1.4130271493266486, 1.034939679612702)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5905
- 夏普比率大于1的概率: 0.2724
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3173
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1056





