

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0696, 标准差: 0.2535, 置信区间: (-0.2615174879915624, 0.19041764944307493)
- 夏普比率的均值: 0.1531, 标准差: 1.2215, 置信区间: (-2.4998705044993015, 0.9970927413433266)
- 最大回撤的均值: -0.1776, 标准差: 0.0875, 置信区间: (-0.5310003167281462, -0.10365892335851612)
- 年化波动率的均值: 0.1647, 标准差: 0.0636, 置信区间: (0.08205338645064196, 0.22373033432643136)
- 索提诺比率的均值: 0.2339, 标准差: 1.3181, 置信区间: (-2.509733080827447, 1.1802449344011607)
- 卡玛比率的均值: 0.1290, 标准差: 0.9588, 置信区间: (-1.3714677458122448, 0.9395094828605176)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5804
- 夏普比率大于1的概率: 0.1977
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2596
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1746





