

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0912, 标准差: 0.2427, 置信区间: (-0.4567118887008961, 0.2937518132775091)
- 夏普比率的均值: 0.3932, 标准差: 1.3378, 置信区间: (-2.6273408905331634, 1.5430095827225476)
- 最大回撤的均值: -0.1961, 标准差: 0.0863, 置信区间: (-0.4311530242305861, -0.12527377765251801)
- 年化波动率的均值: 0.1689, 标准差: 0.0630, 置信区间: (0.08940730341075125, 0.22499182073728016)
- 索提诺比率的均值: 0.4596, 标准差: 1.4843, 置信区间: (-2.4423511104617126, 1.6296716795983404)
- 卡玛比率的均值: 0.3521, 标准差: 0.9899, 置信区间: (-1.355795282663082, 1.3502305321292125)
- 年化收益率大于0的概率: 0.6306
- 夏普比率大于1的概率: 0.3380
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3629
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1255





