

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0886, 标准差: 0.2458, 置信区间: (-0.29949944162306874, 0.174366737979569)
- 夏普比率的均值: 0.3397, 标准差: 1.0045, 置信区间: (-1.8190823515978443, 1.0141476374179998)
- 最大回撤的均值: -0.1527, 标准差: 0.1005, 置信区间: (-0.5223333499790594, -0.0736051991633423)
- 年化波动率的均值: 0.1577, 标准差: 0.0797, 置信区间: (0.06275749010339875, 0.21580126752449638)
- 索提诺比率的均值: 0.3983, 标准差: 1.1709, 置信区间: (-2.1023957385123597, 1.2494632801632077)
- 卡玛比率的均值: 0.3160, 标准差: 0.8999, 置信区间: (-1.3587167845727122, 1.0603898287852733)
- 年化收益率大于0的概率: 0.6403
- 夏普比率大于1的概率: 0.2127
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2752
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.3810



