

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0758, 标准差: 0.2317, 置信区间: (-0.4630419197591437, 0.28059929949368745)
- 夏普比率的均值: 0.3206, 标准差: 1.3032, 置信区间: (-2.6132876771434335, 1.502971524128063)
- 最大回撤的均值: -0.1942, 标准差: 0.0831, 置信区间: (-0.40972614053545475, -0.12892241781221425)
- 年化波动率的均值: 0.1681, 标准差: 0.0609, 置信区间: (0.08897630692070696, 0.22522569987636862)
- 索提诺比率的均值: 0.3649, 标准差: 1.4118, 置信区间: (-2.4706067412992203, 1.5124699284396395)
- 卡玛比率的均值: 0.3139, 标准差: 0.9745, 置信区间: (-1.3793874682288134, 1.3038208642159637)
- 年化收益率大于0的概率: 0.6273
- 夏普比率大于1的概率: 0.3198
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3350
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1279





