

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0698, 标准差: 0.2396, 置信区间: (-0.3083363275799911, 0.21433025181252363)
- 夏普比率的均值: 0.1993, 标准差: 1.1377, 置信区间: (-2.117305944665961, 1.1561512929704254)
- 最大回撤的均值: -0.1814, 标准差: 0.0882, 置信区间: (-0.533231695657558, -0.1030676660923312)
- 年化波动率的均值: 0.1670, 标准差: 0.0696, 置信区间: (0.07384091795509345, 0.22813093871895154)
- 索提诺比率的均值: 0.3152, 标准差: 1.1883, 置信区间: (-1.8781821654499693, 1.3303669007664147)
- 卡玛比率的均值: 0.1690, 标准差: 0.9410, 置信区间: (-1.3960629097545647, 1.0125008304543688)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5704
- 夏普比率大于1的概率: 0.2697
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3171
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1902





