

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0368, 标准差: 0.1942, 置信区间: (-0.23180604883351774, 0.1010533216580205)
- 夏普比率的均值: 0.0364, 标准差: 1.0709, 置信区间: (-2.6710068283745634, 0.7185263193788353)
- 最大回撤的均值: -0.1344, 标准差: 0.0777, 置信区间: (-0.4652922785639414, -0.06918425905253478)
- 年化波动率的均值: 0.1343, 标准差: 0.0663, 置信区间: (0.05140060891733401, 0.19702177754116657)
- 索提诺比率的均值: 0.0523, 标准差: 1.1179, 置信区间: (-2.533198444853172, 0.7281053649956905)
- 卡玛比率的均值: 0.0714, 标准差: 0.8694, 置信区间: (-1.406796391168716, 0.7578914067751958)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5275
- 夏普比率大于1的概率: 0.1077
- 索提诺比率大于1的概率: 0.1180
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.4021





