

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.1667, 标准差: 0.1290, 置信区间: (-0.11092281297004092, 0.3042589738279029)
- 夏普比率的均值: 0.8264, 标准差: 0.5138, 置信区间: (-0.49165977364360647, 1.273811995203521)
- 最大回撤的均值: -0.2600, 标准差: 0.0969, 置信区间: (-0.42764892947089805, -0.15425828753296744)
- 年化波动率的均值: 0.1795, 标准差: 0.0643, 置信区间: (0.04872387479794919, 0.2517482556407182)
- 索提诺比率的均值: 0.9585, 标准差: 0.6530, 置信区间: (-0.391409377769674, 1.594257475328677)
- 卡玛比率的均值: 0.5567, 标准差: 0.3345, 置信区间: (-0.3797446855900547, 0.8611961162628686)
- 年化收益率大于0的概率: 0.9054
- 夏普比率大于1的概率: 0.3632
- 索提诺比率大于1的概率: 0.4718
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.0592



