

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.1281, 标准差: 0.3474, 置信区间: (-0.31823295573628163, 0.24044407157699266)
- 夏普比率的均值: 0.4131, 标准差: 1.4474, 置信区间: (-2.7157929647571857, 1.3857648565815825)
- 最大回撤的均值: -0.1847, 标准差: 0.1018, 置信区间: (-0.5354277281980049, -0.09738966889194811)
- 年化波动率的均值: 0.1695, 标准差: 0.0872, 置信区间: (0.07024105521686921, 0.23423708868904308)
- 索提诺比率的均值: 0.4687, 标准差: 1.6204, 置信区间: (-2.8342658969613344, 1.55014315038589)
- 卡玛比率的均值: 0.3936, 标准差: 1.0901, 置信区间: (-1.4041704625741882, 1.326527848099424)
- 年化收益率大于0的概率: 0.6345
- 夏普比率大于1的概率: 0.3020
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3205
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.2130



