

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0843, 标准差: 0.2319, 置信区间: (-0.4666738292183774, 0.2817226737555636)
- 夏普比率的均值: 0.3601, 标准差: 1.2962, 置信区间: (-2.6913214480888388, 1.5384217472563402)
- 最大回撤的均值: -0.1945, 标准差: 0.0846, 置信区间: (-0.4049581356452878, -0.11968314172458794)
- 年化波动率的均值: 0.1687, 标准差: 0.0609, 置信区间: (0.08976537760620006, 0.22535309825476257)
- 索提诺比率的均值: 0.4085, 标准差: 1.4013, 置信区间: (-2.4764902359662435, 1.5297827729752156)
- 卡玛比率的均值: 0.3525, 标准差: 0.9707, 置信区间: (-1.386585720959715, 1.3100618542279518)
- 年化收益率大于0的概率: 0.6454
- 夏普比率大于1的概率: 0.3361
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3500
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1352





