

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0751, 标准差: 0.3167, 置信区间: (-0.44306236833406176, 0.2240872067755884)
- 夏普比率的均值: 0.1647, 标准差: 1.4575, 置信区间: (-2.4894133347182796, 1.128607762094094)
- 最大回撤的均值: -0.1875, 标准差: 0.0923, 置信区间: (-0.5007367562950106, -0.12193095734460235)
- 年化波动率的均值: 0.1678, 标准差: 0.0614, 置信区间: (0.08642468976300337, 0.22419773452716849)
- 索提诺比率的均值: 0.1904, 标准差: 1.5298, 置信区间: (-2.7273392557975518, 1.2943136578332342)
- 卡玛比率的均值: 0.1528, 标准差: 1.0743, 置信区间: (-1.403867316826654, 1.1006354876796167)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5273
- 夏普比率大于1的概率: 0.2537
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2970
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1039





