

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0843, 标准差: 0.2400, 置信区间: (-0.295888556239502, 0.1576311182406691)
- 夏普比率均值: 0.3507, 标准差: 0.9933, 置信区间: (-1.998675210077858, 0.9932842391878062)
- 最大回撤均值: -0.1510, 标准差: 0.0946, 置信区间: (-0.5435777411513756, -0.08398241186762079)
- 年化波动率均值: 0.1545, 标准差: 0.0767, 置信区间: (0.06878749175709756, 0.20521122285813617)
- 索提诺比率的均值: 0.4257, 标准差: 1.2135, 置信区间: (-2.4259363671407086, 1.2061813029244004)
- 卡玛比率的均值: 0.3457, 标准差: 0.8893, 置信区间: (-1.3644467490007268, 1.0544046421936406)
- 年化收益率大于0的概率: 0.6826
- 夏普比率大于1的概率: 0.1978
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2665
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.3719



