

# 蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0704, 标准差: 0.2558, 置信区间: (-0.2857460001533034, 0.1961918544120571)
- 夏普比率的均值: 0.1612, 标准差: 1.2543, 置信区间: (-2.442438693604497, 1.0228738321529698)
- 最大回撤的均值: -0.1779, 标准差: 0.0895, 置信区间: (-0.5291567198955962, -0.10652800233691428)
- 年化波动率的均值: 0.1645, 标准差: 0.0633, 置信区间: (0.08407502811548313, 0.22108789830611142)
- 索提诺比率的均值: 0.2508, 标准差: 1.3408, 置信区间: (-2.5139105821967753, 1.2304399029961388)
- 卡玛比率的均值: 0.1441, 标准差: 0.9947, 置信区间: (-1.3960844090312639, 1.0141237380441612)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5846
- 夏普比率大于1的概率: 0.2097
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2809
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1589





