

## 蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0950, 标准差: 0.3376, 置信区间: (-0.27078875766467736, 0.2086440979155122)
- 夏普比率的均值: 0.2432, 标准差: 1.4309, 置信区间: (-2.715747854736235, 1.0658079701317287)
- 最大回撤的均值: -0.1775, 标准差: 0.0975, 置信区间: (-0.5417187332367547, -0.10556120030565941)
- 年化波动率的均值: 0.1555, 标准差: 0.0666, 置信区间: (0.06859078965516416, 0.2213878003621992)
- 索提诺比率的均值: 0.3515, 标准差: 1.4857, 置信区间: (-2.1333146977347743, 1.200079153086061)
- 卡玛比率的均值: 0.1800, 标准差: 1.0189, 置信区间: (-1.3806815259669576, 1.0198697954625142)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5611
- 夏普比率大于1的概率: 0.2242
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2547
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1898





