

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0893, 标准差: 0.2835, 置信区间: (-0.2601615890157727, 0.2087834721434888)
- 夏普比率的均值: 0.2492, 标准差: 1.3154, 置信区间: (-2.323383483051865, 1.0831812171685873)
- 最大回撤的均值: -0.1809, 标准差: 0.0917, 置信区间: (-0.5158736731156233, -0.1030567061517278)
- 年化波动率的均值: 0.1650, 标准差: 0.0633, 置信区间: (0.08150063127335169, 0.22642382237531078)
- 索提诺比率的均值: 0.3372, 标准差: 1.4070, 置信区间: (-2.4210234546455243, 1.3368279287299578)
- 卡玛比率的均值: 0.1894, 标准差: 1.0016, 置信区间: (-1.3548042257021917, 1.0180356560391752)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5950
- 夏普比率大于1的概率: 0.2390
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3028
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1799





