

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.1173, 标准差: 0.2936, 置信区间: (-0.252397613282063, 0.3362471930851625)
- 夏普比率的均值: 0.3506, 标准差: 1.3523, 置信区间: (-1.9021863618004944, 1.4890476175016718)
- 最大回撤的均值: -0.1932, 标准差: 0.0789, 置信区间: (-0.4393066117634008, -0.12456157829891923)
- 年化波动率的均值: 0.1778, 标准差: 0.0566, 置信区间: (0.09231966482063748, 0.23950793956044822)
- 索提诺比率的均值: 0.4095, 标准差: 1.5249, 置信区间: (-2.419625907212011, 1.529397712550669)
- 卡玛比率的均值: 0.3161, 标准差: 1.0933, 置信区间: (-1.398943861336508, 1.4184996829590022)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5550
- 夏普比率大于1的概率: 0.3209
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3377
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.0739



