

# 蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.1000, 标准差: 0.3154, 置信区间: (-0.2872806201280771, 0.2387302651823876)
- 夏普比率的均值: 0.2806, 标准差: 1.3374, 置信区间: (-2.179109696226676, 1.2224499189196651)
- 最大回撤的均值: -0.1852, 标准差: 0.0933, 置信区间: (-0.5396088500249274, -0.11756480356523735)
- 年化波动率的均值: 0.1700, 标准差: 0.0706, 置信区间: (0.07610276667421816, 0.23193019876356186)
- 索提诺比率的均值: 0.3940, 标准差: 1.4379, 置信区间: (-2.0558489600699, 1.3634715267516144)
- 卡玛比率的均值: 0.2339, 标准差: 1.0342, 置信区间: (-1.398976076488439, 1.12762335791891)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5731
- 夏普比率大于1的概率: 0.2963
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3480
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1389





