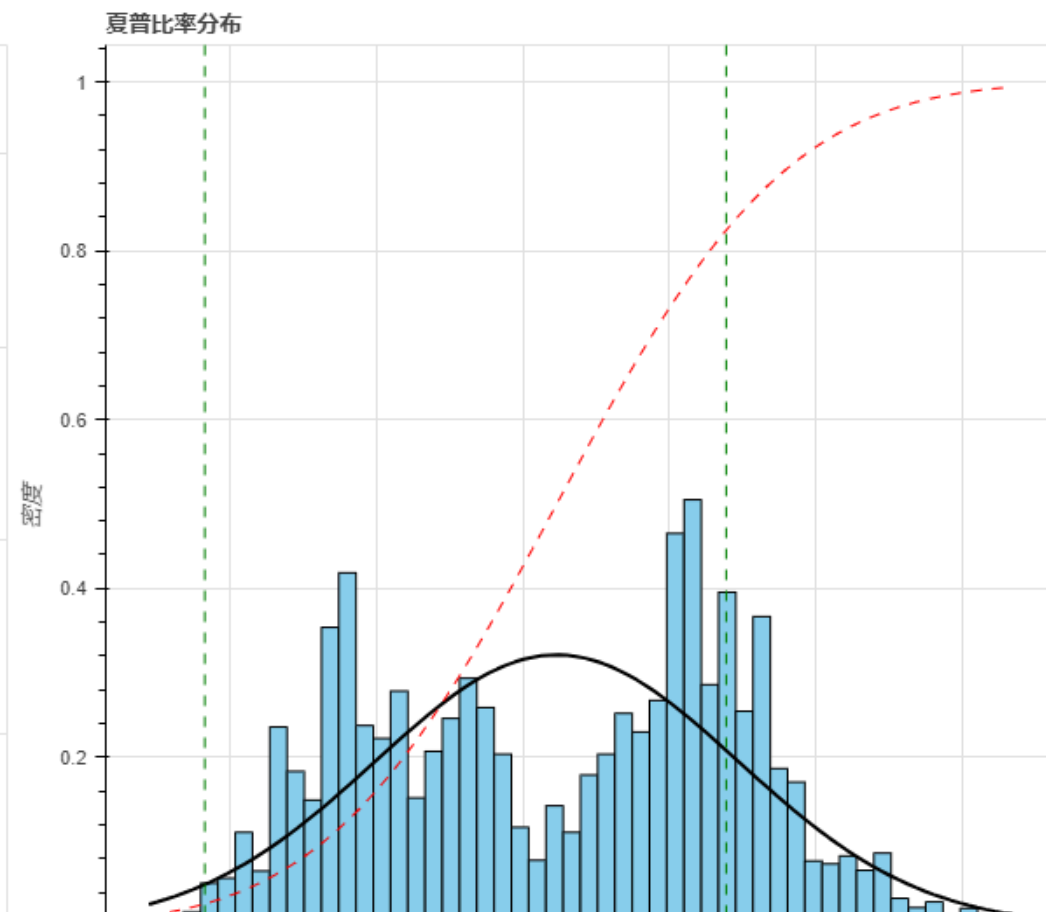
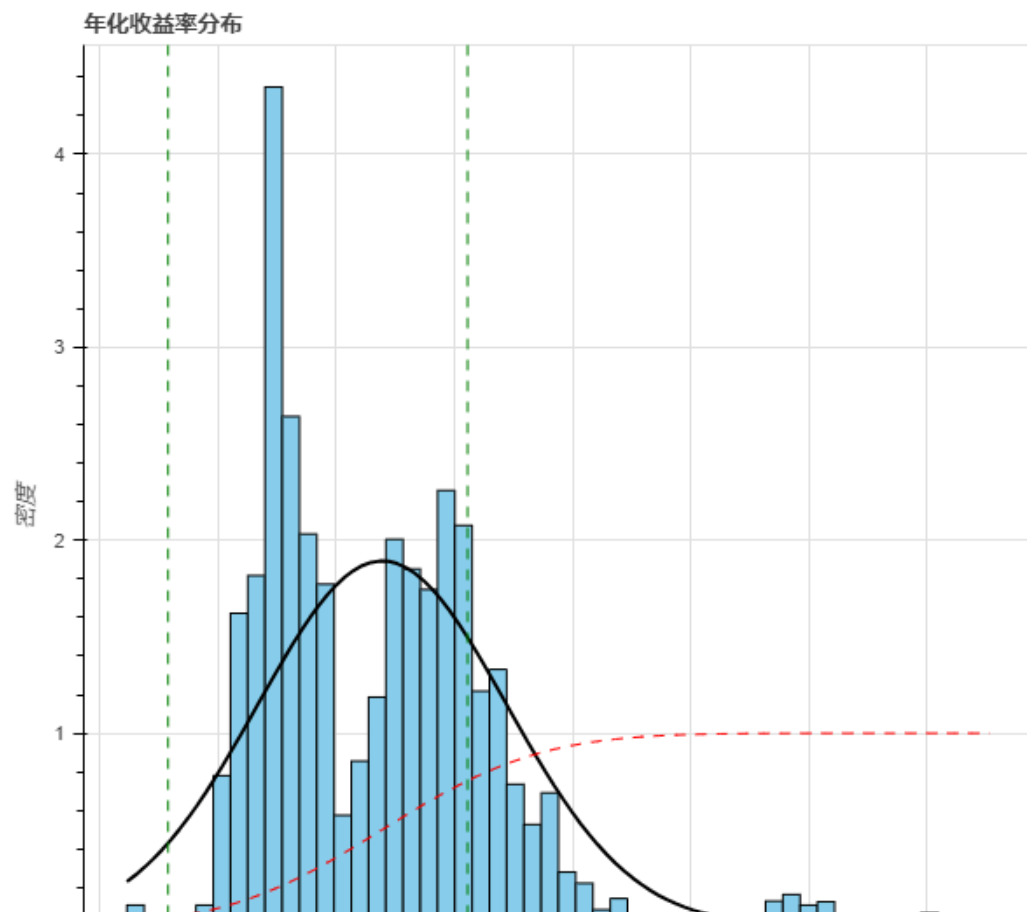
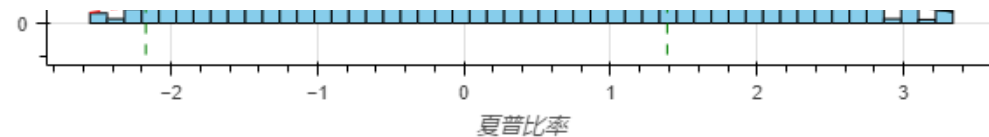
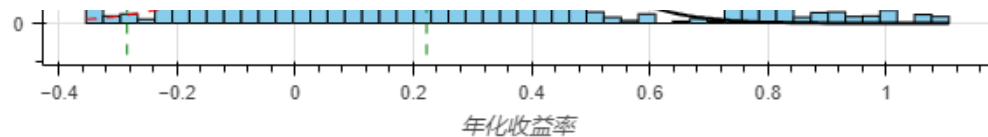


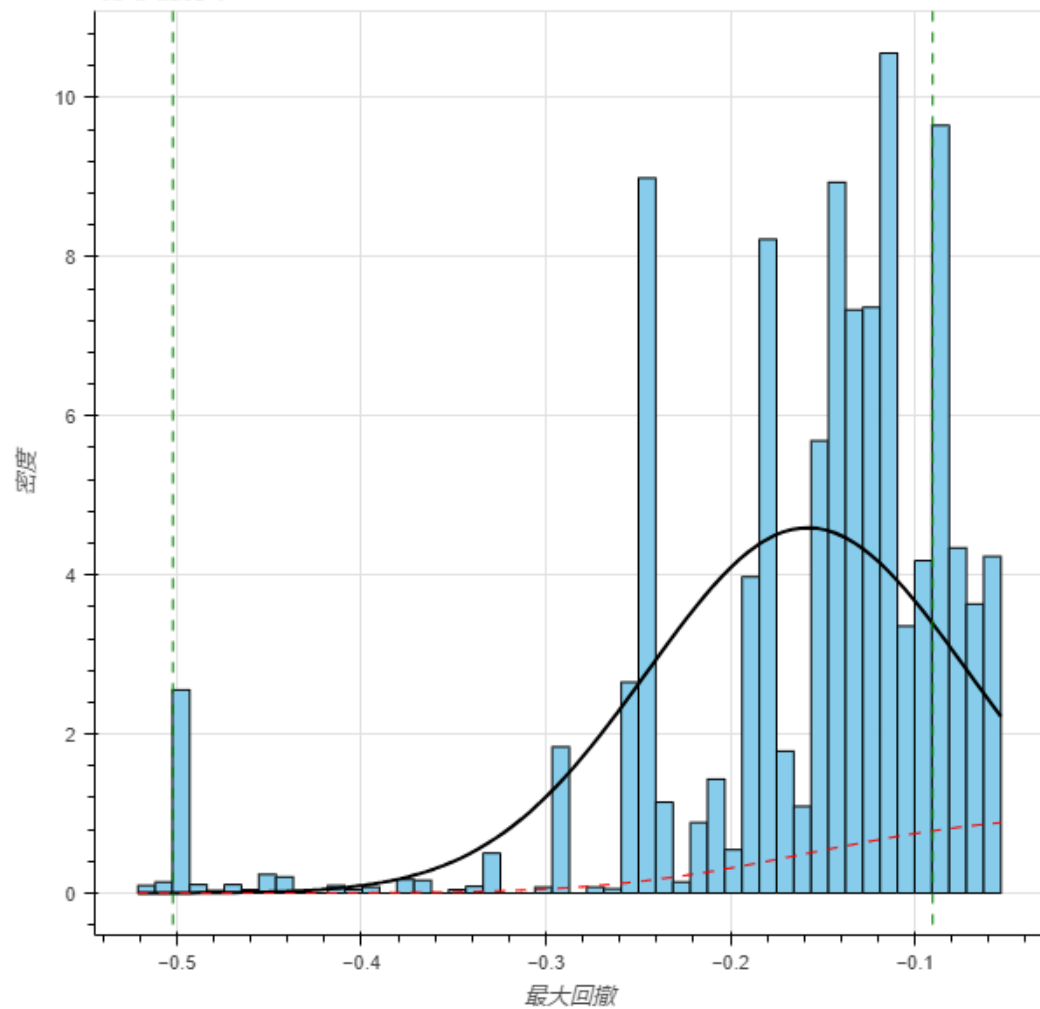
## 蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0778, 标准差: 0.2108, 置信区间: (-0.2848102613232728, 0.2223327280224412)
- 夏普比率的均值: 0.2300, 标准差: 1.2415, 置信区间: (-2.172175495031851, 1.3864087442425175)
- 最大回撤的均值: -0.1581, 标准差: 0.0868, 置信区间: (-0.5021529321096447, -0.09035085009576904)
- 年化波动率的均值: 0.1480, 标准差: 0.0680, 置信区间: (0.058731741678429254, 0.21123552832058062)
- 索提诺比率的均值: 0.3617, 标准差: 1.2829, 置信区间: (-1.8699339168346591, 1.5834894235707841)
- 卡玛比率的均值: 0.1844, 标准差: 1.0470, 置信区间: (-1.3919132719532017, 1.208652801166991)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5484
- 夏普比率大于1的概率: 0.3629
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3779
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.2436

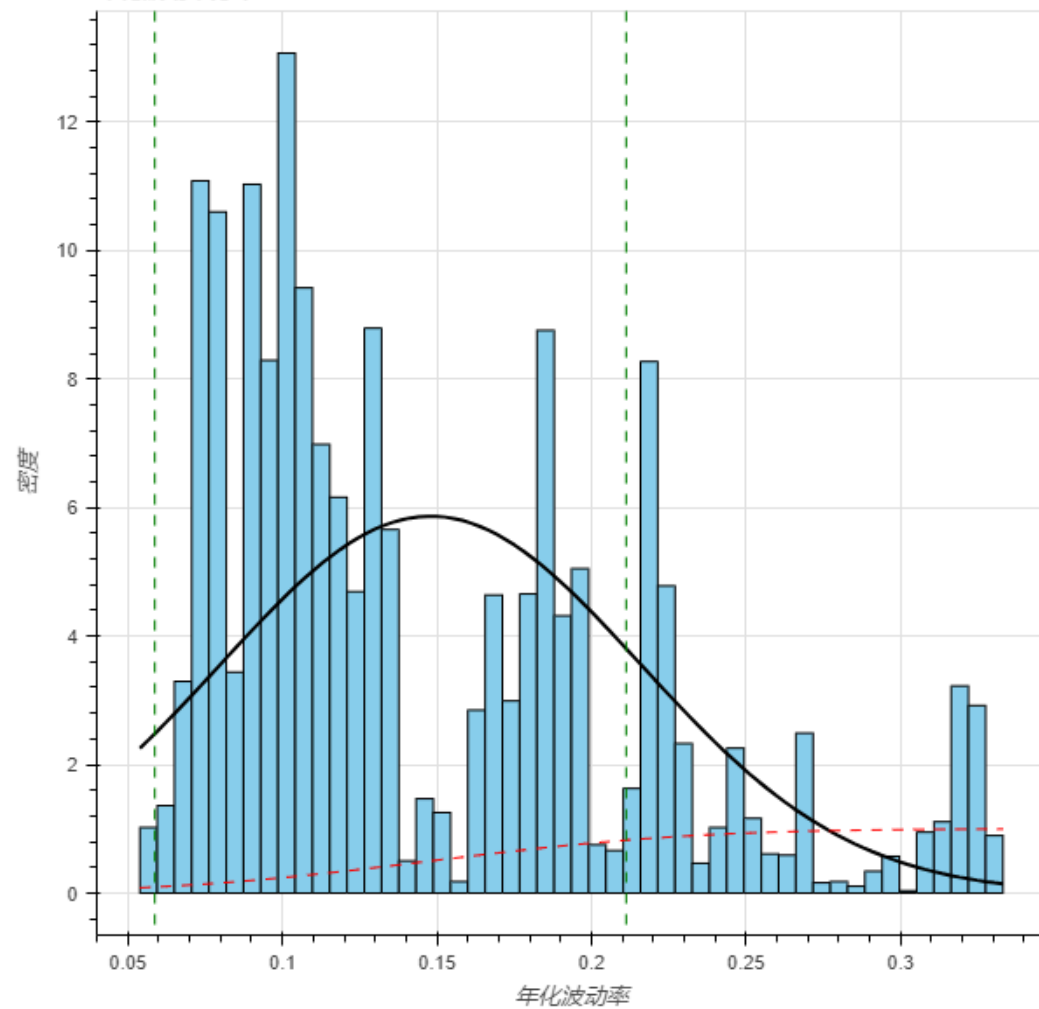




最大回撤分布



年化波动率分布



索提诺比率分布



卡玛比率分布



