

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0957, 标准差: 0.2473, 置信区间: (-0.45948278871054105, 0.2948718073578711)
- 夏普比率的均值: 0.4133, 标准差: 1.3620, 置信区间: (-2.6297106770373175, 1.6086033804776005)
- 最大回撤的均值: -0.1969, 标准差: 0.0862, 置信区间: (-0.44242588713701403, -0.12641305085290866)
- 年化波动率的均值: 0.1688, 标准差: 0.0632, 置信区间: (0.0892264138475717, 0.22651192657144217)
- 索提诺比率的均值: 0.4801, 标准差: 1.4992, 置信区间: (-2.4282591083242253, 1.6217425678477917)
- 卡玛比率的均值: 0.3692, 标准差: 0.9935, 置信区间: (-1.38571530603644, 1.3668729169093423)
- 年化收益率大于0的概率: 0.6523
- 夏普比率大于1的概率: 0.3424
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3528
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1287





