

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0897, 标准差: 0.2849, 置信区间: (-0.27001081824180595, 0.224405547161175)
- 夏普比率的均值: 0.2288, 标准差: 1.3059, 置信区间: (-2.3006093476242295, 1.108355359763268)
- 最大回撤的均值: -0.1814, 标准差: 0.0930, 置信区间: (-0.5205086575675459, -0.11405912689303173)
- 年化波动率的均值: 0.1653, 标准差: 0.0642, 置信区间: (0.08395917084329171, 0.2290291521437382)
- 索提诺比率的均值: 0.3011, 标准差: 1.3752, 置信区间: (-2.3351951289965345, 1.2695400997934154)
- 卡玛比率的均值: 0.1937, 标准差: 1.0017, 置信区间: (-1.3409463200393008, 1.054643035025629)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5950
- 夏普比率大于1的概率: 0.2353
- 索提诺比率大于1的概率: 0.2981
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1708





