

蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.0825, 标准差: 0.2844, 置信区间: (-0.27882306113162325, 0.22221750025556264)
- 夏普比率的均值: 0.1858, 标准差: 1.3763, 置信区间: (-2.3456524542292763, 1.2618344853547376)
- 最大回撤的均值: -0.1800, 标准差: 0.0924, 置信区间: (-0.5292990171962666, -0.11063827151211492)
- 年化波动率的均值: 0.1625, 标准差: 0.0655, 置信区间: (0.07959520502861762, 0.22999823725253402)
- 索提诺比率的均值: 0.2663, 标准差: 1.4693, 置信区间: (-2.560959299760176, 1.4041637411254013)
- 卡玛比率的均值: 0.1610, 标准差: 1.0603, 置信区间: (-1.3996595937343208, 1.1736525435637484)
- 年化收益率大于0的概率: 0.5658
- 夏普比率大于1的概率: 0.2885
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3224
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.1165





