

## 蒙特卡洛模拟统计结果

- 年化收益率的均值: 0.1328, 标准差: 0.1270, 置信区间: (-0.06711684174255272, 0.24598837581891764)
- 夏普比率的均值: 1.2282, 标准差: 1.0054, 置信区间: (-0.6625698291910629, 1.9429874333433554)
- 最大回撤的均值: -0.1238, 标准差: 0.0601, 置信区间: (-0.2553742674092322, -0.0627023476589118)
- 年化波动率的均值: 0.1031, 标准差: 0.0365, 置信区间: (0.040375260995953954, 0.1301968244948066)
- 索提诺比率的均值: 0.8446, 标准差: 0.7495, 置信区间: (-0.2660631253486956, 1.516960104292351)
- 卡玛比率的均值: 0.9447, 标准差: 0.6378, 置信区间: (-0.6440648238580834, 1.3335117160102856)
- 年化收益率大于0的概率: 0.8613
- 夏普比率大于1的概率: 0.5406
- 索提诺比率大于1的概率: 0.3629
- 最大回撤大于-0.1的概率: 0.4178





