

# model1因子分析

参数:hs300

## 一、因子表现

year	年化收益 (%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差 (%)
2019	-3.23	-0.27	1.05	0.1148	0.1202
2020	1.14	0.09	1.73	0.1611	0.1254
2021	20.46	1.9	0.3	0.0397	0.1077
2022	25.39	1.57	0.71	0.0986	0.1617
2023	20.8	1.77	0.86	0.0761	0.1175
2024	-6.81	-0.26	4.12	0.3271	0.2599
2025	48.27	3.17	4.12	0.0391	0.1521

## 回测区间因子表现

year	年化收益 (%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差 (%)
回测区间	14.49	0.92	3.27	0.3406	0.1573

## 二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

