

model1因子分析

参数:hs300

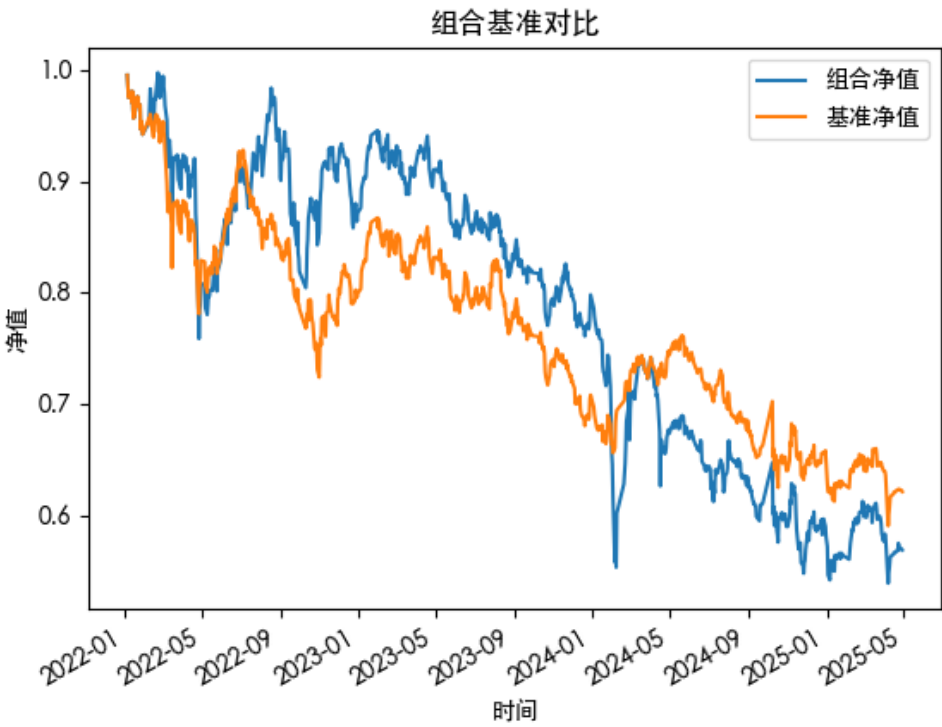
一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	9.0	0.55	0.86	0.103	0.1623
2023	3.32	0.53	0.12	0.0584	0.063
2024	-21.54	-0.94	2.32	0.2886	0.2281
2025	7.09	0.67	2.19	0.0413	0.1052

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	-2.72	-0.17	1.64	0.3353	0.1602

二、净值回测图



超额净值

