

model1因子分析

参数:zz2000

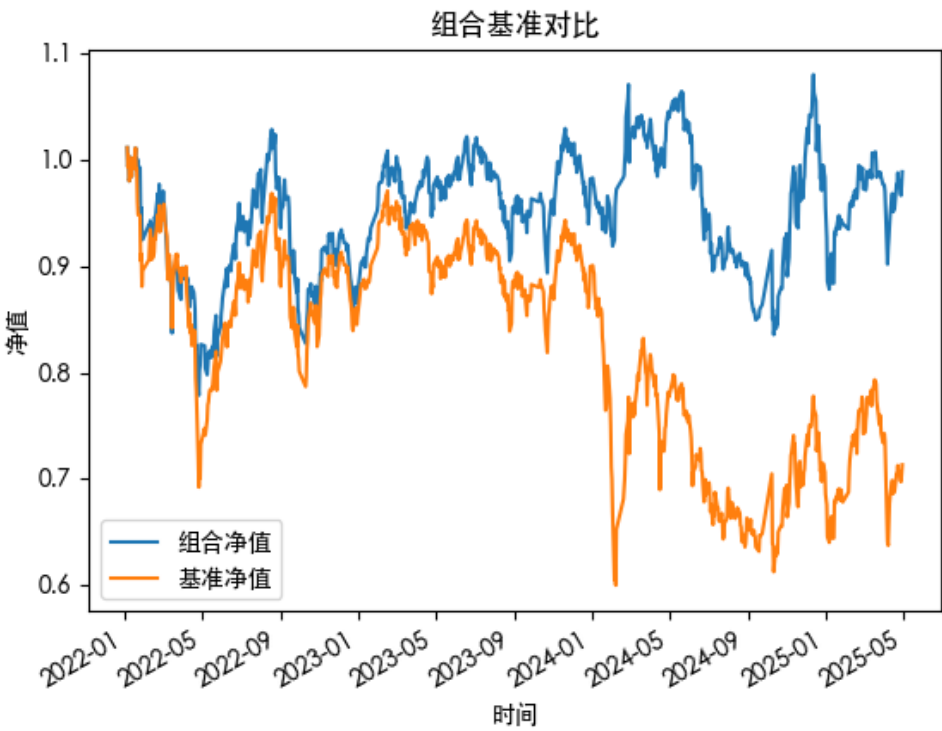
一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	1.05	0.08	-0.16	0.1226	0.1246
2023	6.82	1.49	-0.33	0.0316	0.0458
2024	21.46	0.91	-1.94	0.2369	0.2364
2025	-6.35	-0.35	-2.44	0.0949	0.1833

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	8.44	0.53	-1.04	0.2514	0.1584

二、净值回测图



超额净值

