

Combine因子分析

参数:沪深300

一、因子表现

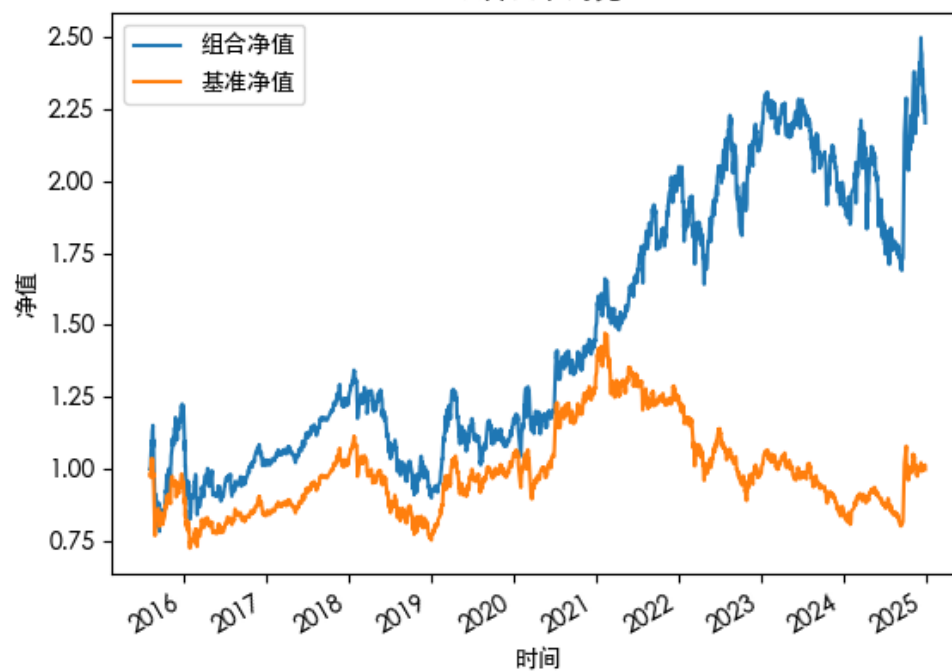
year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2015	65.83	2.45	4.23	0.1747	0.2688
2016	-3.3	-0.23	2.61	0.1131	0.1413
2017	-0.0	-0.0	-0.48	0.0031	0.0055
2018	-1.02	-0.1	0.88	0.0957	0.1005
2019	-6.74	-0.58	0.85	0.1427	0.116
2020	1.14	0.12	1.64	0.1183	0.0983
2021	43.19	2.65	0.7	0.0922	0.1629
2022	34.78	2.1	1.06	0.0983	0.166
2023	5.83	0.6	0.41	0.0761	0.0979
2024	-3.52	-0.16	3.65	0.1917	0.2198

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	13.25	0.92	4.16	0.1917	0.144

二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

