

Combine因子分析

参数:中证2000

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	-7.65	-1.4	-0.66	0.0553	0.0545
2016	-4.64	-0.53	-1.72	0.0918	0.0875
2017	58.32	3.63	-0.75	0.0651	0.1608
2018	21.64	1.83	0.44	0.083	0.1183
2019	1.76	0.2	-1.15	0.0506	0.087
2020	6.69	0.59	-0.65	0.1197	0.114
2021	-1.29	-0.1	0.1	0.2096	0.1328
2022	23.68	2.35	0.06	0.0428	0.1008
2023	-7.6	-0.87	-0.92	0.1204	0.087
2024	24.9	1.39	-0.87	0.1345	0.1795

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	18.07	1.5	-0.43	0.2096	0.1208

二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

