

model1因子分析

参数:大小盘等权

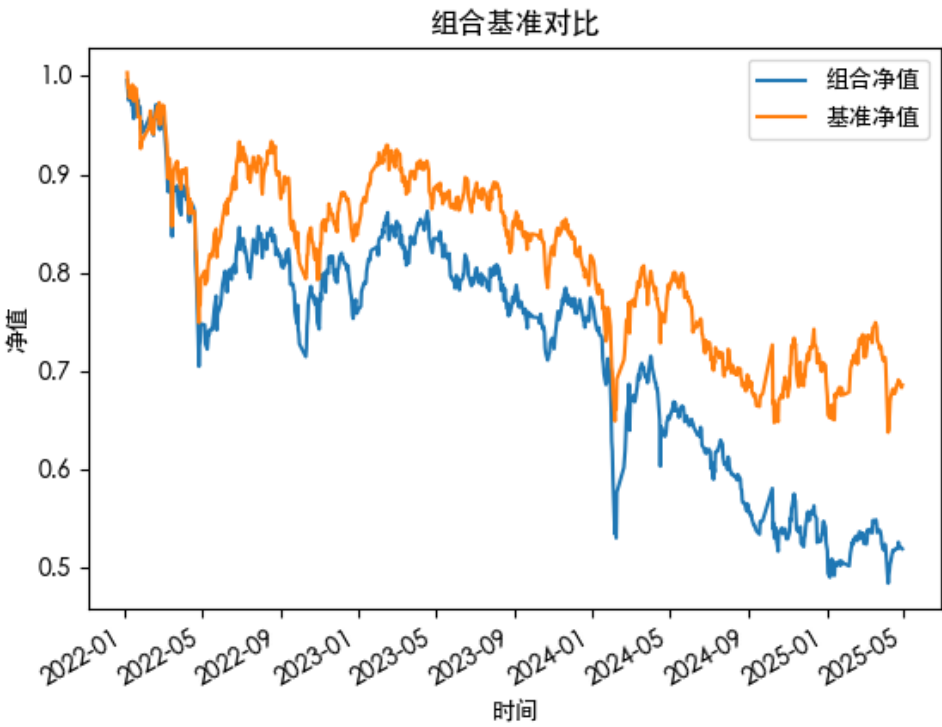
一、因子表现

| year | 年化收益(%) | 夏普比率 | 信息比率 | 最大回撤 | 年化标准差(%) |
|------|---------|-------|-------|--------|----------|
| 2022 | -10.17 | -1.02 | 1.33 | 0.1308 | 0.1001 |
| 2023 | 5.0 | 0.73 | 1.18 | 0.07 | 0.0681 |
| 2024 | -20.65 | -1.42 | 0.26 | 0.2246 | 0.1458 |
| 2025 | -3.37 | -0.3 | -0.41 | 0.0556 | 0.1123 |

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 | -7.75 | -0.71 | 0.69 | 0.2893 | 0.1094 |

二、净值回测图



超额净值

