

# 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	3.67	0.37	2.73	0.0879	0.1003
2023	-5.94	-0.87	0.13	0.1024	0.0681
2024	-14.3	-0.98	0.44	0.1799	0.1462
2025	-6.47	-0.58	-1.1	0.0437	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	-5.42	-0.5	0.86	0.2603	0.1095

## 二、净值回测图



