

model1因子分析

参数:大小盘等权

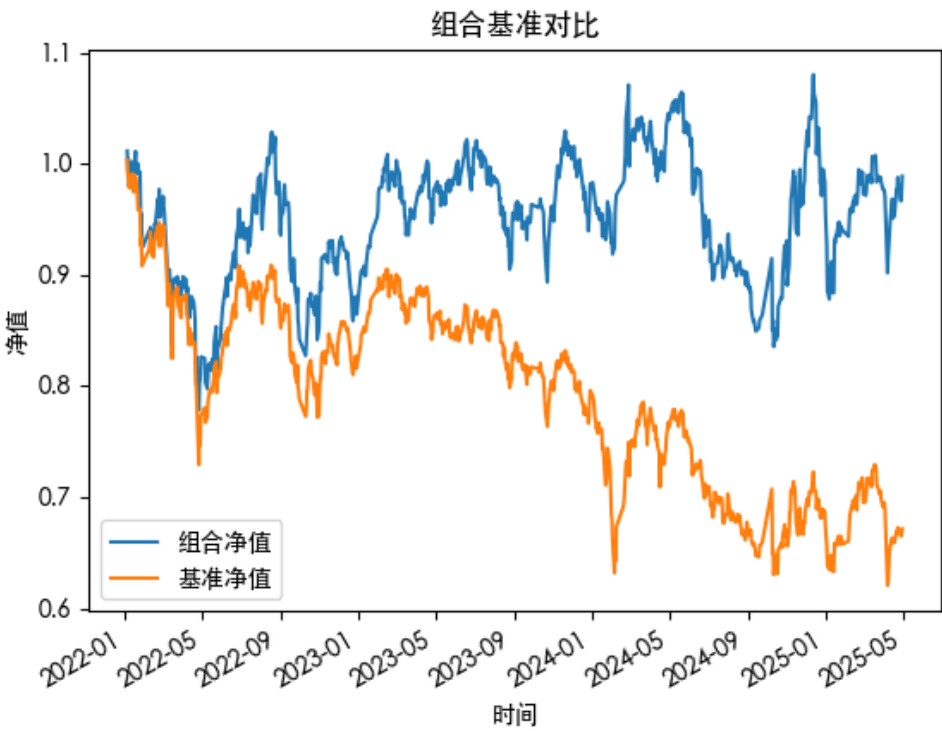
一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	6.61	0.66	2.95	0.0635	0.1002
2023	17.1	2.54	3.25	0.0422	0.0674
2024	15.1	1.03	-0.13	0.1448	0.1461
2025	10.36	0.92	1.07	0.0387	0.1121

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	14.48	1.33	1.68	0.1448	0.1092

二、净值回测图



超额净值

