

# 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 (%)
2019	-5.33	-0.68	2.85	0.1047	0.0788
2020	-3.18	-0.41	2.43	0.1189	0.078
2021	18.81	1.74	2.93	0.0805	0.1084
2022	4.15	0.41	3.47	0.1146	0.1003
2023	12.44	1.83	2.62	0.0385	0.0678
2024	-21.9	-1.51	2.91	0.2263	0.1452
2025	-6.41	-0.57	3.95	0.065	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	-0.35	-0.03	6.03	0.2652	0.1006

## 二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

