

model1因子分析

参数:大小盘等权

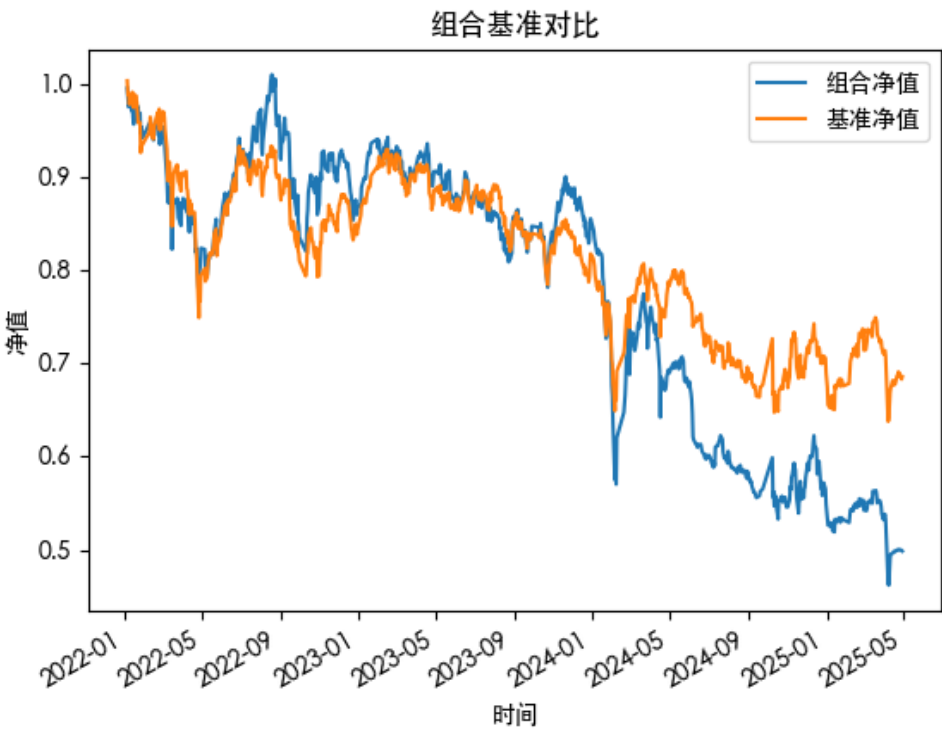
一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	2.8	0.28	2.23	0.0657	0.1003
2023	1.9	0.28	2.01	0.0772	0.0682
2024	-24.68	-1.7	1.27	0.2429	0.1454
2025	-28.19	-2.54	-1.98	0.1058	0.1108

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	-8.4	-0.77	1.45	0.3355	0.1094

二、净值回测图



超额净值

