

model1因子分析

参数:hs300

一、因子表现

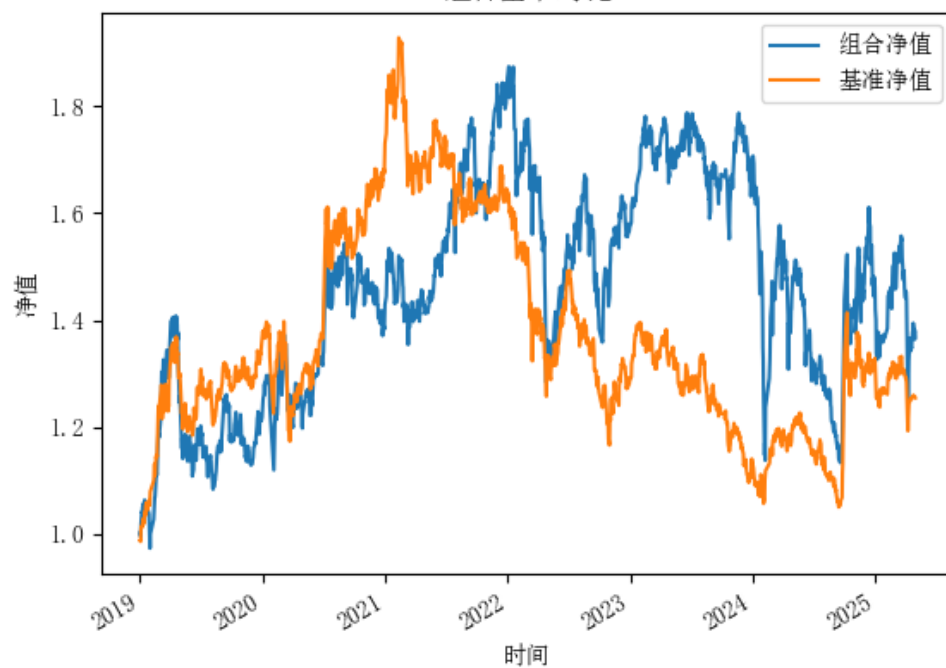
year	年化收益 (%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差 (%)
2019	-10.74	-0.71	1.85	0.1827	0.1521
2020	-8.11	-0.57	1.9	0.2091	0.142
2021	36.11	1.97	0.7	0.1072	0.1829
2022	8.22	0.44	0.85	0.1581	0.1872
2023	22.69	1.79	0.95	0.0761	0.1265
2024	-28.18	-1.04	3.42	0.3271	0.2715
2025	5.42	0.25	3.31	0.1239	0.2129

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	1.39	0.08	3.85	0.3406	0.1849

二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

