

model1因子分析

参数:zz2000

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	7.21	0.71	-1.16	0.0607	0.1022
2020	11.05	1.19	-0.54	0.0905	0.0928
2021	-11.44	-0.61	-0.45	0.2962	0.189
2022	14.03	1.19	-0.43	0.0824	0.1175
2023	0.73	0.11	-0.82	0.0467	0.0681
2024	6.91	0.52	-0.99	0.1031	0.1327
2025	6.92	0.42	-2.04	0.0745	0.1656

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	5.11	0.41	-0.6	0.3214	0.1254

二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

