

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 (%)
2022	8.19	0.44	0.81	0.1715	0.1866
2023	12.58	1.35	1.35	0.0726	0.0931
2024	0.63	0.02	4.12	0.3271	0.2715
2025	25.67	1.15	4.48	0.12	0.2238

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	9.78	0.49	3.89	0.3271	0.2

二、净值回测图



超额净值

