

model1因子分析

参数:zz2000

一、因子表现

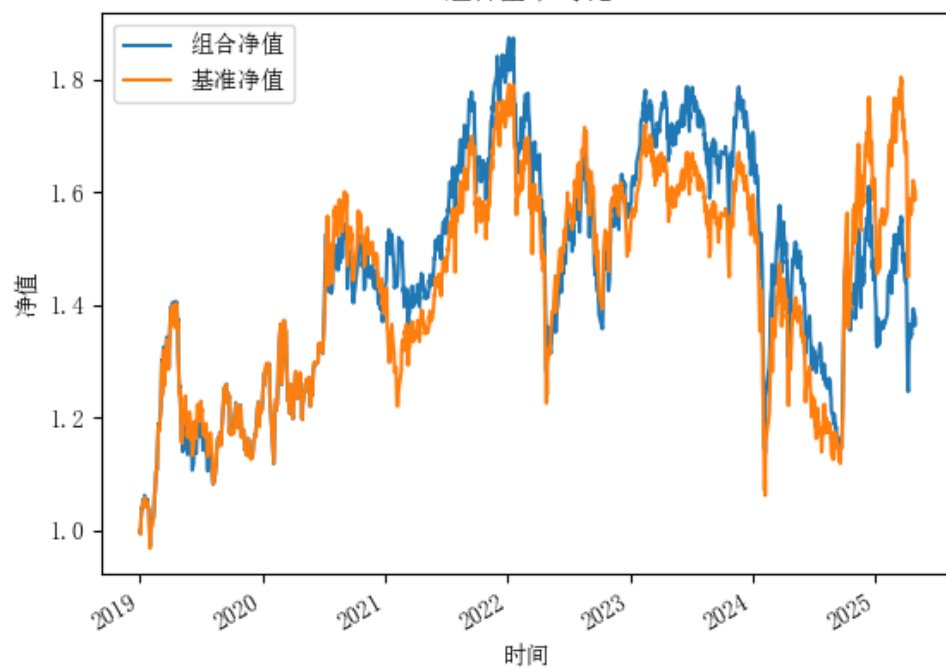
year	年化收益 (%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差 (%)
2019	-0.23	-0.05	0.13	0.0475	0.0414
2020	1.37	0.21	-0.12	0.0868	0.0647
2021	2.43	0.21	0.03	0.1426	0.1169
2022	-0.78	-0.11	-0.19	0.092	0.0719
2023	2.54	0.52	-0.8	0.0178	0.0491
2024	-16.94	-1.61	-1.83	0.2146	0.1051
2025	-19.01	-2.7	-3.29	0.0581	0.0705

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	-2.8	-0.35	-0.58	0.3124	0.0793

二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

