

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	4.11	0.41	3.6	0.0974	0.1003
2023	2.76	0.4	2.14	0.0826	0.0682
2024	9.27	0.64	3.96	0.1775	0.1458
2025	13.38	1.19	6.39	0.0609	0.112

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	6.58	0.6	5.46	0.1891	0.1096

二、净值回测图



超额净值

