

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 (%)
2022	-0.82	-0.11	-0.27	0.0766	0.0736
2023	-6.66	-0.67	-0.37	0.1185	0.0993
2024	16.11	1.51	-1.01	0.0816	0.1066
2025	0.25	0.24	0.0	0.0036	0.0103

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	2.29	0.26	-0.53	0.1185	0.0897

二、净值回测图



超额净值

