

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 (%)
2019	2.17	0.28	0.89	0.0588	0.0789
2020	6.3	0.81	2.3	0.1047	0.078
2021	3.94	0.36	1.12	0.1304	0.109
2022	20.17	2.03	2.7	0.0676	0.0996
2023	10.58	1.56	2.14	0.0394	0.0679
2024	0.9	0.06	3.66	0.1775	0.1459
2025	27.66	2.47	2.45	0.0377	0.1121

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	10.19	1.01	3.76	0.1857	0.1005

二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

