

model1因子分析

参数:zz2000

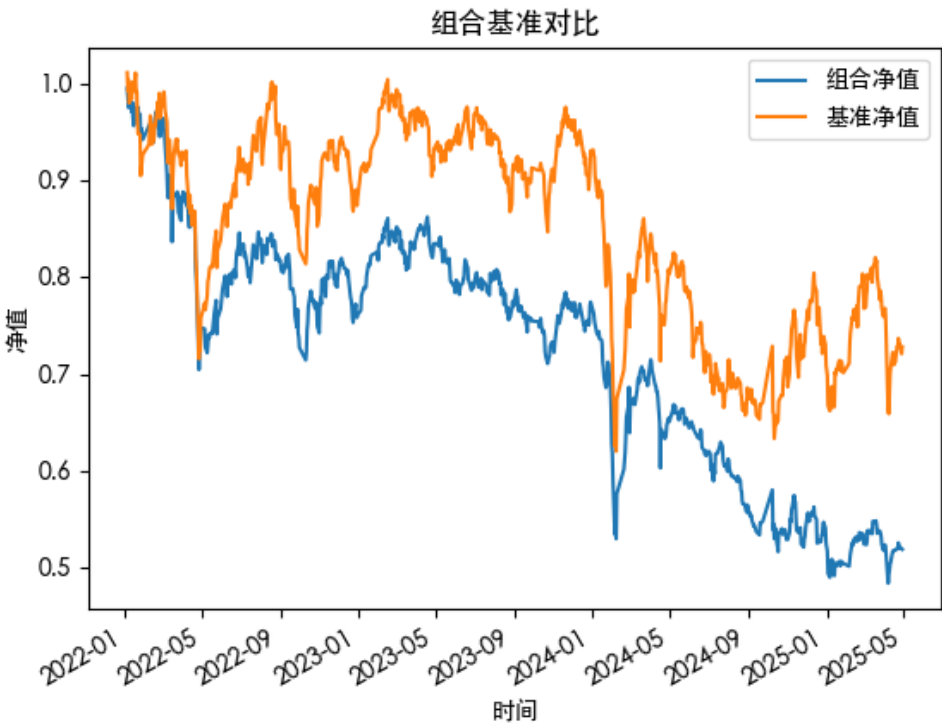
一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	-15.96	-1.0	-0.42	0.2089	0.1601
2023	-4.78	-0.42	-0.82	0.1232	0.115
2024	-15.19	-0.84	-2.0	0.2665	0.1816
2025	-17.63	-0.9	-2.76	0.1092	0.1954

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	-10.89	-0.69	-1.06	0.4072	0.1586

二、净值回测图



超额净值

