

# model1因子分析

参数:大小盘等权

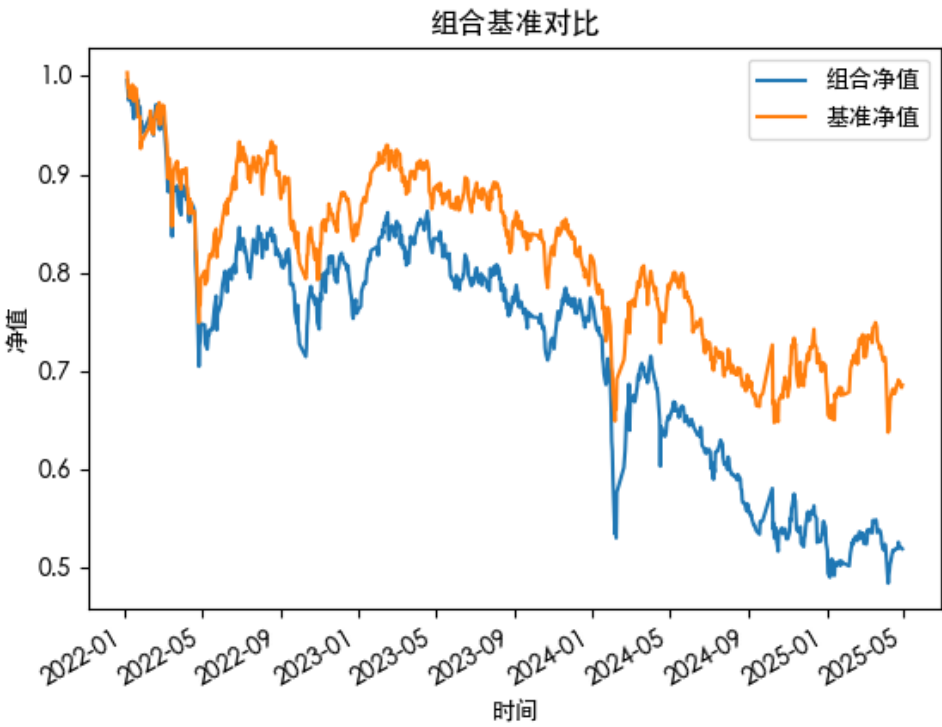
## 一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	-10.17	-1.02	1.33	0.1308	0.1001
2023	5.0	0.73	1.18	0.07	0.0681
2024	-20.65	-1.42	0.26	0.2246	0.1458
2025	-3.37	-0.3	-0.41	0.0556	0.1123

## 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	-7.75	-0.71	0.69	0.2893	0.1094

## 二、净值回测图



超额净值

