

model1因子分析

参数:hs300

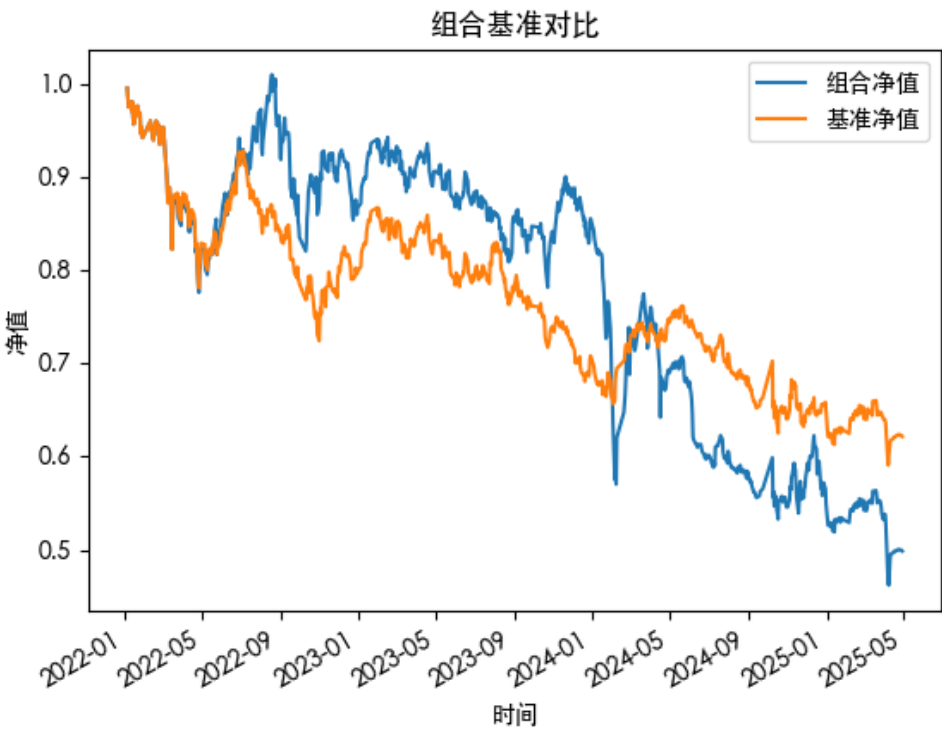
一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	8.33	0.56	0.85	0.1041	0.1477
2023	11.57	1.16	1.0	0.0753	0.0995
2024	-31.59	-1.24	2.59	0.3154	0.2554
2025	-15.82	-1.23	1.36	0.0957	0.1287

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	-6.21	-0.35	1.98	0.3845	0.175

二、净值回测图



超额净值

