

# Combine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(%)
2015	27.74	2.02	4.77	0.0905	0.1375
2016	-3.64	-0.44	2.17	0.0916	0.083
2017	26.32	3.27	-0.1	0.0329	0.0805
2018	10.08	1.3	1.66	0.0452	0.0777
2019	-2.33	-0.32	0.82	0.0621	0.0726
2020	4.17	0.55	1.32	0.09	0.0752
2021	19.61	1.86	2.85	0.0877	0.1053
2022	29.73	3.09	3.88	0.0487	0.0963
2023	-0.89	-0.14	1.49	0.0531	0.0658
2024	10.91	0.77	3.11	0.1081	0.1419

## 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	16.64	1.77	4.95	0.1106	0.0939

## 二、净值回测图

组合基准对比



超额净值

