

# model1因子分析

参数:zz2000

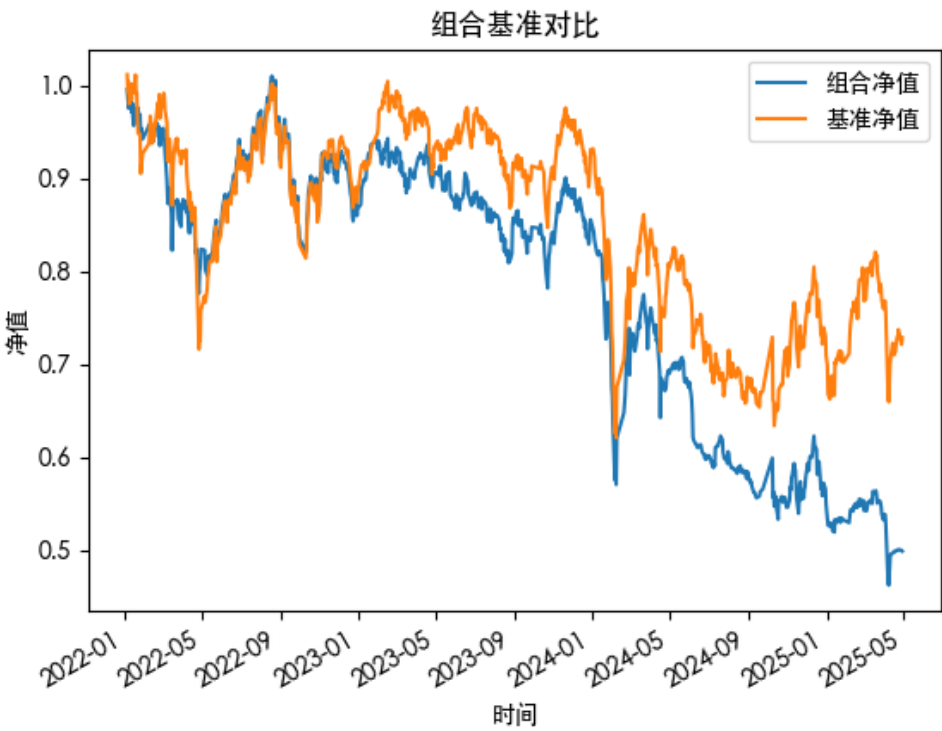
## 一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	-3.43	-0.25	-0.31	0.1219	0.1356
2023	-7.39	-0.8	-0.64	0.1136	0.0928
2024	-18.95	-1.34	-2.16	0.1953	0.1413
2025	-41.17	-2.26	-3.54	0.1538	0.1819

## 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	-11.2	-0.85	-1.16	0.414	0.1315

## 二、净值回测图



超额净值

