

model1因子分析

参数:hs300

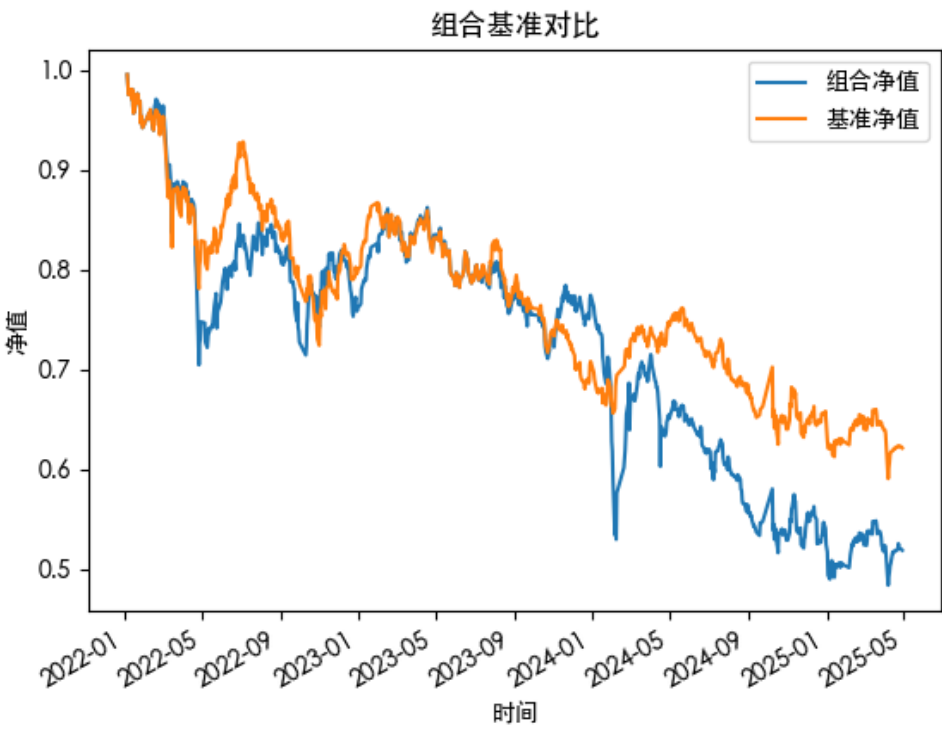
一、因子表现

year	年化收益(%)	夏普比率	信息比率	最大回撤	年化标准差(%)
2022	-4.96	-0.41	0.81	0.1208	0.1203
2023	15.21	2.09	0.82	0.0433	0.0728
2024	-27.41	-1.2	2.31	0.298	0.2288
2025	10.27	0.93	2.8	0.0391	0.1101

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	-5.16	-0.34	1.87	0.3069	0.1508

二、净值回测图



超额净值

