

# 排排网全市场 重点私募基金跟踪周报

2024年01月03日

统计区间：2023-12-22至 2023-12-29

WWW.PPWFUND.COM

## 免责声明

本报告由深圳市前海排排网基金销售有限责任公司制作及发布，仅供投资者参考使用，不构成任何投资建议，不代表本公司对产品业绩做出任何实质性判断或保证，投资者不应以本报告作为投资决策的唯一因素。本公司不承担因阅读和使用本报告所造成的任何损失及其产生的法律责任。

本报告所展示的数据包括基础数据和衍生数据（经基础数据加工处理），基础数据来源于私募排排网数据库/基金管理人/托管人/估值核算机构，本公司无法对数据的真实性、准确性或者完整性做出任何保证，亦不保证本报告所含信息保持在最新状态。请投资者以监管部门、管理人及其委托的估值核算机构经复核的信息及数据为准。投资者应谨慎注意各项风险，认真阅读相关销售文件，查看历史净值等各项数据的波动及来源情况，充分认识产品的风险收益特征，审慎独立地作出投资决策，并对投资决策自负盈亏。本报告的版权归属本公司所有，仅供对应投资者自行阅读。未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式（包括但不限于转发、翻译、复制、刊登、发表或者引用等）将本报告向第三方展示或擅自修改。

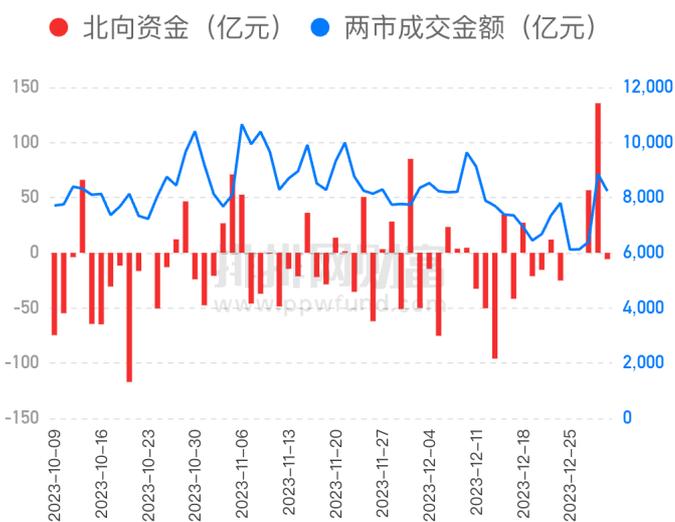
## 各市场指数主要表现

数据截止：2023-12-29

	收盘价	本周涨跌幅	今年来收益	近1年收益	近3年涨跌幅
上证指数	2974.9348	2.06%	-3.70%	-3.70%	-12.87%
深证成指	9524.6895	3.29%	-13.54%	-13.54%	-32.93%
创业板指数	1891.3665	3.59%	-19.41%	-19.41%	-34.79%
沪深300	3431.1099	2.81%	-11.38%	-11.38%	-32.90%
中证500	5429.2288	2.21%	-7.42%	-7.42%	-13.40%
中证全债	237.0151	0.43%	5.23%	5.23%	15.06%
南华商品指数	2528.2365	-1.39%	6.20%	6.20%	54.32%

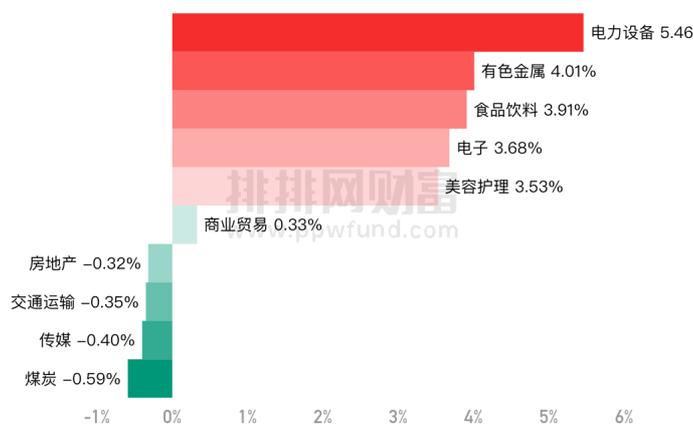
	指数值	本周涨跌幅	今年来收益	近1年收益	近3年收益	近5年收益
排排网·主观多头	3221.4100	1.93%	-6.42%	-6.42%	-14.17%	40.83%
排排网·量化多头	2561.9000	2.07%	0.94%	0.94%	5.14%	72.85%
排排网·主观CTA	3503.6300	0.53%	-1.20%	-1.20%	9.35%	54.15%
排排网·量化CTA	3291.3700	0.23%	0.09%	0.09%	10.74%	57.59%
排排网·复合策略	2274.3300	1.36%	-2.25%	-2.25%	1.95%	47.94%
排排网·套利策略	2473.2200	0.85%	2.81%	2.81%	11.63%	45.58%

近三个月沪深两市成交额及北向资金净流入情况



数据截止：2023-12-29

申万一级板块本周涨跌前5&后5



数据截止：2023-12-29

# 融智系列指数走势

排排网财富

买基金，就上排排网财富

## 一、走势图（近三年）

数据截止：2023-12-29

### 1、排排网·主观多头策略指数



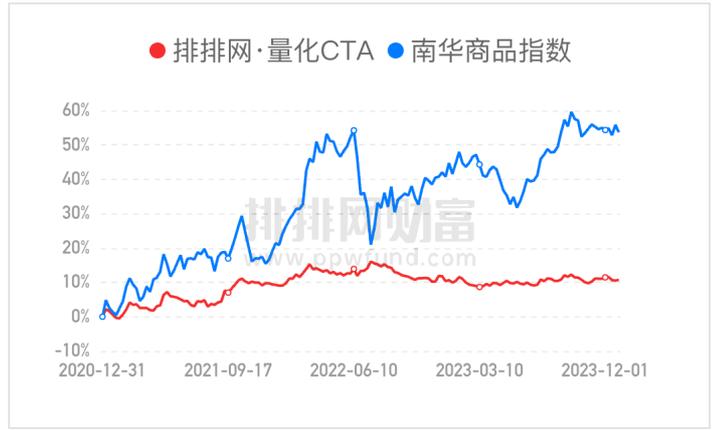
### 2、排排网·量化多头策略指数



### 3、排排网·主观CTA策略指数



### 4、排排网·量化CTA策略指数



### 5、排排网·复合策略指数

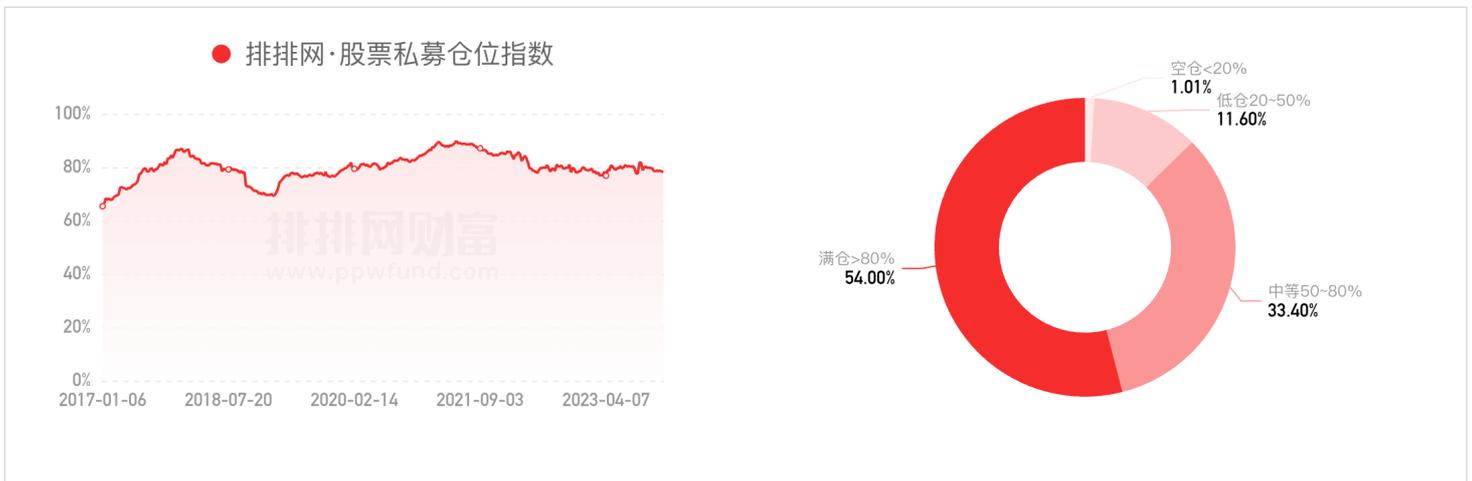


### 6、排排网·套利策略指数



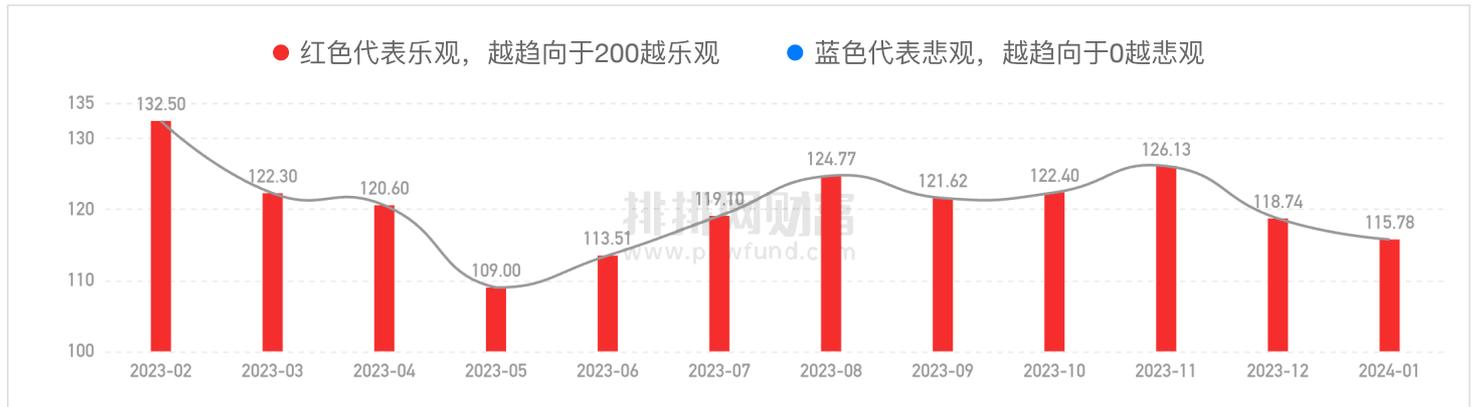
## 二、排排网·股票策略仓位指数（成立来）

数据截止：2023-12-22

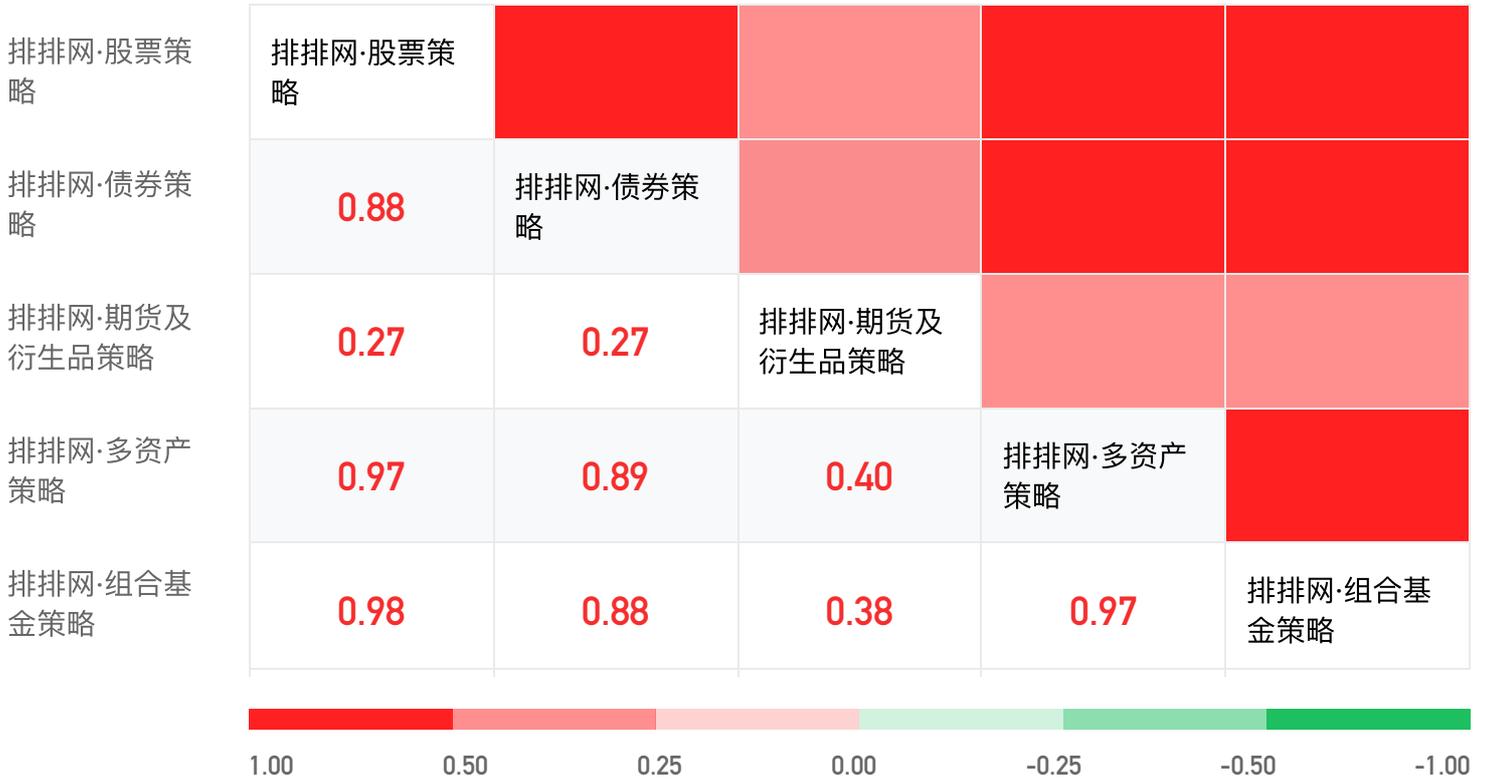


### 三、排排网·对冲基金信心指数（近一年）

数据截止：2024-01-02



### 四、私募策略相关性（统计区间：2020-12-30 - 2023-12-29）



### 1、股票大盘指数

数据截至：2023-12-29

股票指数	上证指数	深证成指	创业板指	科创50	上证50	沪深300	中证500	中证1000
本周涨跌	2.06%	3.29%	3.59%	1.03%	2.45%	2.81%	2.21%	2.67%
2023年11月	0.36%	-1.39%	-2.32%	-1.00%	-1.89%	-2.14%	0.30%	1.86%
2023年10月	-2.95%	-2.43%	-1.78%	-1.51%	-3.81%	-3.17%	-2.86%	-1.80%
2023年09月	-0.30%	-2.96%	-4.69%	-5.82%	-0.13%	-2.01%	-0.85%	-0.42%
2023年08月	-5.20%	-6.85%	-6.00%	-2.72%	-5.39%	-6.21%	-5.73%	-6.32%
2023年07月	2.78%	1.43%	0.98%	-3.60%	6.47%	4.48%	1.49%	-1.31%
2023年06月	-0.08%	2.16%	0.98%	-4.63%	-0.05%	1.16%	-0.81%	0.62%

### 2、股票风格指数

数据截至：2023-12-29

风格指数	大盘价值	大盘成长	中盘价值	中盘成长	小盘价值	小盘成长
本周涨跌	2.09%	3.43%	1.79%	3.29%	1.29%	3.02%
2023年11月	-2.63%	-4.15%	-1.34%	-2.00%	0.14%	0.17%
2023年10月	-4.85%	-1.52%	-4.06%	-3.25%	-3.15%	-3.37%
2023年09月	0.71%	-4.14%	0.58%	-2.70%	1.20%	0.19%
2023年08月	-5.55%	-6.76%	-5.14%	-7.26%	-6.20%	-6.33%
2023年07月	4.95%	4.31%	5.23%	0.58%	4.10%	-1.24%
2023年06月	0.16%	1.26%	-1.81%	1.68%	-1.71%	-0.36%

### 3、商品指数

数据截至：2023-12-29

商品指数	南华商品	南华金属	南华工业品	南华能化	南华农产品	南华贵金属	南华黑色	南华有色
本周涨跌	-1.39%	-0.50%	-1.67%	-2.57%	-0.43%	-0.48%	-0.95%	-0.59%
2023年11月	0.91%	0.91%	0.41%	-0.29%	-0.64%	1.46%	5.53%	-3.00%
2023年10月	-1.95%	0.27%	-1.90%	-3.83%	-5.05%	3.12%	1.09%	-1.76%
2023年09月	1.30%	-1.71%	2.48%	5.90%	-2.50%	-1.55%	1.74%	-1.94%
2023年08月	4.27%	1.99%	3.55%	5.05%	4.12%	2.11%	4.04%	-0.37%
2023年07月	6.49%	4.40%	7.08%	9.47%	5.13%	2.99%	4.05%	5.69%
2023年06月	7.66%	6.78%	6.66%	5.64%	7.44%	-0.38%	10.45%	3.43%

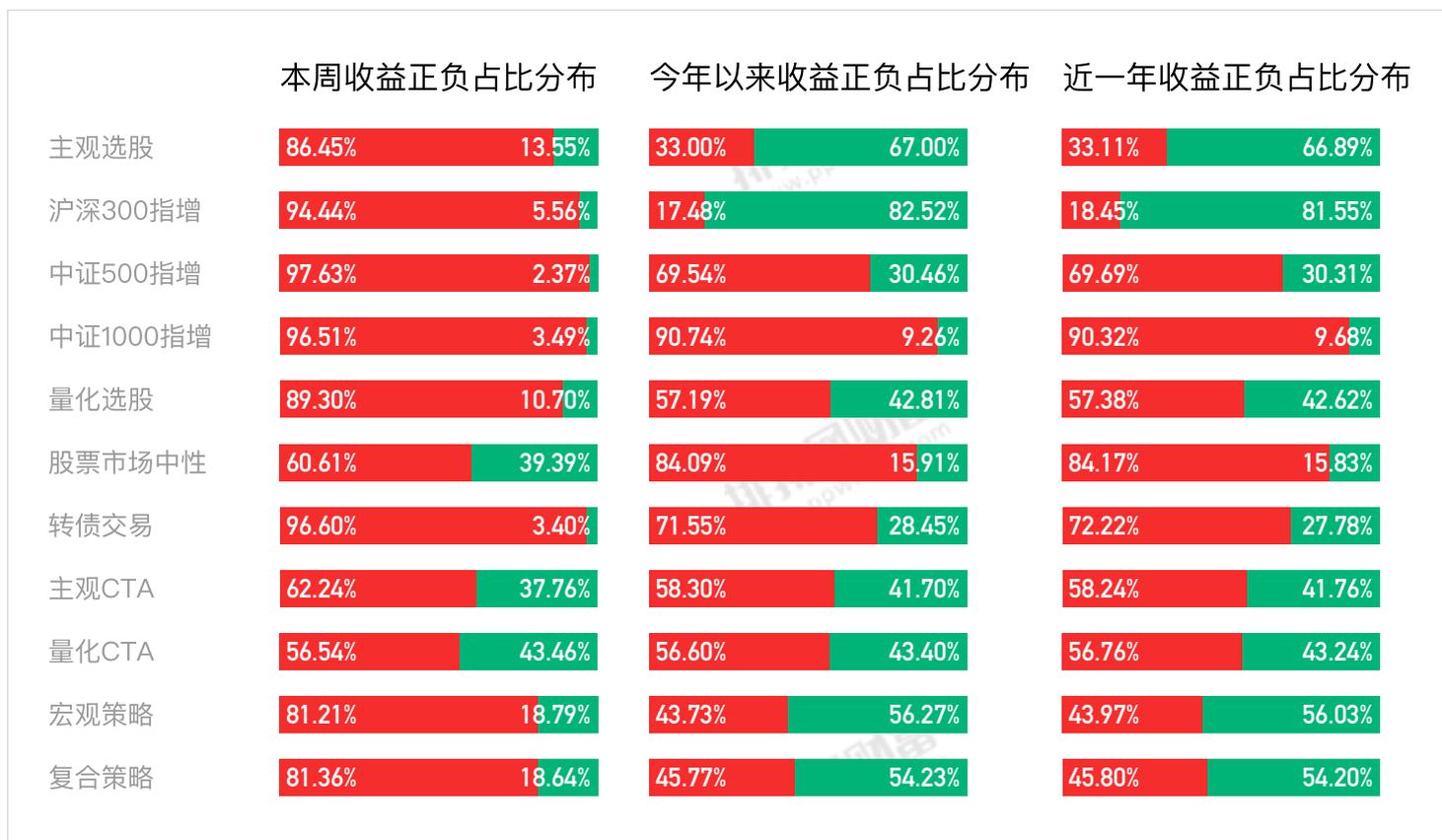
# 私募策略业绩统计

排排网财富

买基金，就上排排网财富

每类策略本周的表现分布图如下，具体每类策略业绩表现详见下文：

数据截止：2023-12-29



数据来源：私募排排网组合大师，数据为全市场各策略，存续且在中基协备案，更新到最新截止日期净值的所有产品简单数据统计。

## 一、主观多头

数据截至：2023-12-29

		上证指数	2.06%	-0.94%	-3.70%	-3.70%	14.61%					--	
		深证成指	3.29%	-1.75%	-13.54%	-13.54%	24.68%					--	
		创业板指数	3.59%	-1.23%	-19.41%	-19.41%	31.03%					--	
管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
				本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	
高新区智领三联私募	林义和	20~50亿	智领兆元汉石2期	11.13%	4.01%	-33.12%	-33.12%	49.84%	22.12%	52.78%	0.60	0.41	
正圆投资	廖茂林	100亿以上	正圆壹号	9.59%	-0.95%	-29.96%	-29.96%	51.03%	55.98%	56.58%	0.97	1.00	
龙航资产	蔡英明	10~20亿	龙航一期	9.54%	-8.55%	-4.55%	-4.55%	33.06%	43.36%	44.81%	0.97	0.96	
集元资产	任泽松	10~20亿	集元-祥瑞1号	7.96%	-13.21%	-28.93%	-28.93%	61.92%	-0.87%	75.99%	0.16	-0.01	
神农投资	陈宇	10~20亿	神农春晓	7.83%	-7.42%	11.80%	11.80%	20.26%	16.63%	33.45%	0.66	0.49	
华安合鑫	袁巍	20~50亿	华安合鑫稳健一期	6.25%	-6.23%	3.73%	3.73%	20.43%	34.26%	29.16%	0.98	1.17	
青岛熙德博远私募	李秋实	0~5亿	熙德博远医疗优选1号	6.24%	-4.35%	-11.27%	-11.27%	35.23%	-1.21%	49.38%	0.03	-0.02	

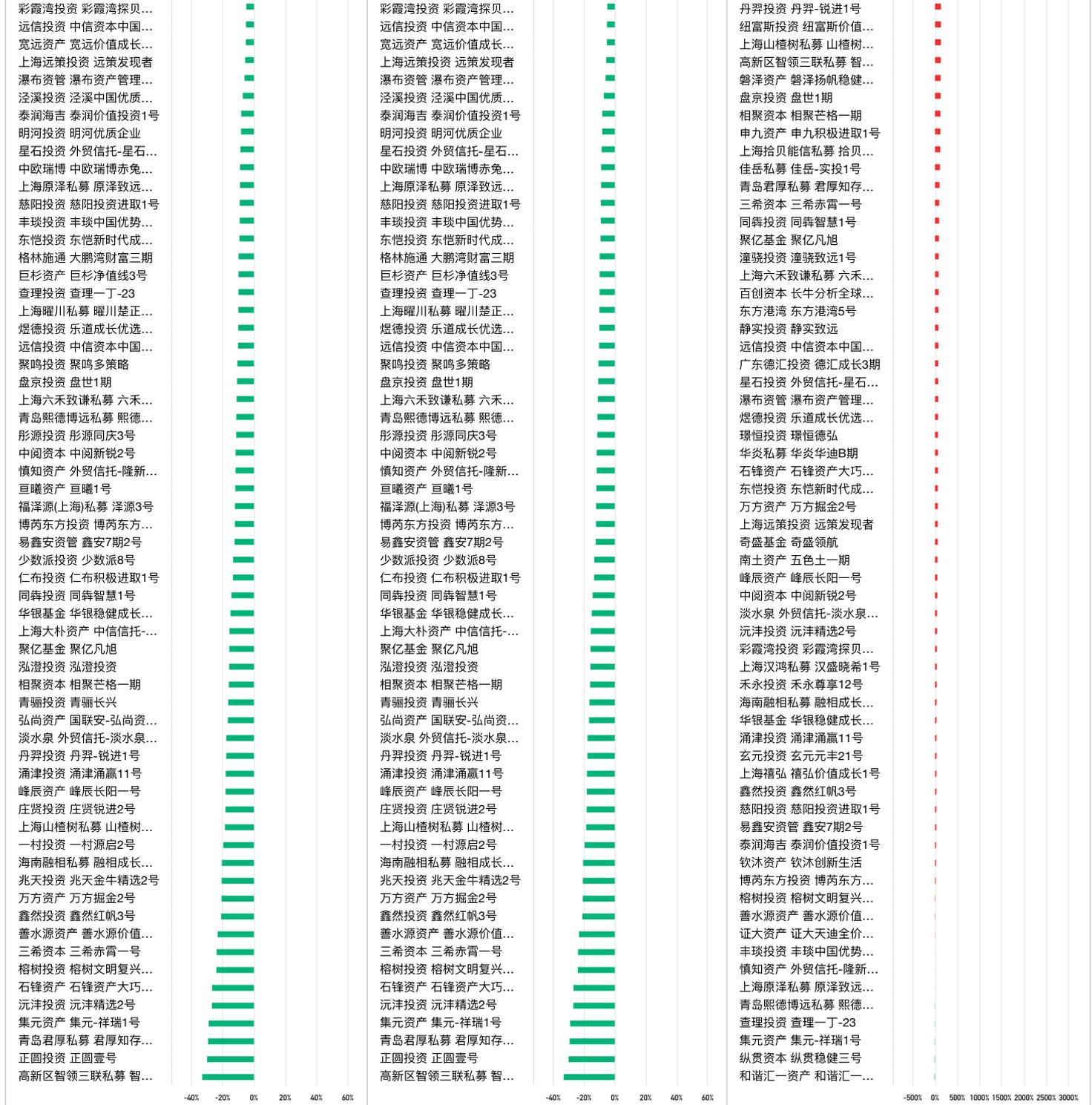
基金名称	管理人	规模	策略	近1月	近3月	近6月	近12月	成立以来	近1月	近3月	近6月	近12月	走势图
理成资产	吴圣涛	20~50亿	理成圣远1号A期	5.76%	-3.00%	10.74%	10.74%	23.28%	22.77%	34.16%	0.82	0.66	
南土资产	吴刚	20~50亿	五色土一期	5.75%	-8.51%	26.29%	26.29%	40.41%	5.73%	70.89%	0.32	0.08	
奇盛基金	付伟琦	10~20亿	奇盛领航	5.60%	-1.72%	10.31%	10.31%	16.04%	16.79%	26.24%	0.75	0.63	
泰润海吉	刘壮波	50~100亿	泰润价值投资1号	5.56%	0.59%	-8.14%	-8.14%	25.79%	2.73%	40.11%	0.16	0.06	
上海原泽私募	杨玉山	0~5亿	原泽致远1号A类份额	4.75%	-3.70%	-8.89%	-8.89%	22.98%	-0.61%	22.98%	-0.06	-0.02	
新思哲投资	韩广斌	50~100亿	新思哲成长基金	4.70%	-1.97%	12.90%	12.90%	16.25%	13.72%	52.59%	0.61	0.26	
鑫然投资	孔令峰	5~10亿	鑫然红帆3号	4.57%	-4.48%	-20.98%	-20.98%	36.10%	6.10%	59.32%	0.29	0.10	
远信投资	周伟锋	100亿以上	中信资本中国价值成长	4.42%	-2.32%	-10.19%	-10.19%	19.36%	18.56%	22.33%	0.87	0.83	
万方资产	钱伟	20~50亿	万方掘金2号	4.41%	-1.19%	-20.71%	-20.71%	29.47%	10.86%	58.57%	0.45	0.18	
佳岳私募	薛松	20~50亿	佳岳-实投1号	4.34%	-0.47%	-0.32%	-0.32%	18.32%	21.79%	18.32%	0.88	1.18	
君之健投资	张勇	50~100亿	君之健翱翔稳进	4.26%	0.09%	24.15%	24.15%	7.88%	11.92%	16.62%	0.87	0.71	
上海六禾致谦私募	夏晓辉	20~50亿	六禾谦恒A	4.05%	-4.53%	-11.07%	-11.07%	25.11%	15.53%	25.11%	0.70	0.61	
大禾投资	胡鲁滨	20~50亿	大禾投资掘金1号	3.94%	-0.68%	4.38%	4.38%	16.66%	37.74%	58.86%	0.95	0.64	
远信投资	谢振东	100亿以上	中信资本中国价值回报	3.94%	-2.28%	-5.09%	-5.09%	14.32%	15.55%	16.71%	0.98	0.93	
同犇投资	童驯	50~100亿	同犇智慧1号	3.89%	1.24%	-14.37%	-14.37%	24.59%	8.94%	64.34%	0.40	0.13	
涌贝资产	谭涛	0~5亿	涌贝阳光稳健	3.85%	-1.21%	8.90%	8.90%	15.20%	27.18%	42.83%	0.77	0.63	
慎知资产	余海丰	100亿以上	外贸信托-隆新6号(慎知资产)	3.74%	-1.52%	-11.73%	-11.73%	21.11%	-0.08%	21.11%	-0.00	-0.00	
弘尚资产	尚健	50~100亿	国联安-弘尚资产成长精选1号	3.70%	-1.34%	-16.68%	-16.68%	26.48%	9.52%	41.30%	0.46	0.23	
泓澄投资	张弢	50~100亿	泓澄投资	3.65%	-4.30%	-15.83%	-15.83%	26.01%	11.26%	46.80%	0.57	0.24	
淡水泉	赵军	100亿以上	外贸信托-淡水泉专项3期	3.63%	-0.59%	-17.69%	-17.69%	26.25%	4.37%	53.08%	0.23	0.08	
璟恒投资	李志强	10~20亿	璟恒德弘	3.51%	-0.99%	-0.75%	-0.75%	19.61%	12.36%	32.39%	0.53	0.38	
和谐汇一资产	梁爽	100亿以上	和谐汇一远致1号7期	3.43%	-0.84%	-2.97%	-2.97%	14.98%	-3.64%	25.45%	-0.32	-0.14	
巨曦资产	董高峰	50~100亿	巨曦1号	3.40%	-4.48%	-11.95%	-11.95%	22.73%	31.90%	28.39%	1.09	1.12	
查理投资	李一丁	0~5亿	查理一丁-23	3.32%	-2.75%	-9.88%	-9.88%	37.22%	-1.13%	65.62%	0.07	-0.01	
康曼德资本	丁楹	100亿以上	康曼德003号	3.23%	-2.37%	8.88%	8.88%	10.23%	20.72%	26.24%	1.02	0.78	
潼骁投资	陈开伟	20~50亿	潼骁致远1号	3.17%	-0.23%	-2.76%	-2.76%	24.34%	10.35%	25.96%	0.46	0.39	
彩霞湾投资	鲁俊	20~50亿	彩霞湾探贝二期	3.17%	-1.73%	-4.86%	-4.86%	16.03%	9.76%	28.82%	0.48	0.33	
彤源投资	薛凌云	20~50亿	彤源同庆3号	3.12%	-2.79%	-11.34%	-11.34%	21.51%	17.71%	30.13%	0.76	0.58	
星石投资	江晖,郭希淳,汪晟,万凯航,方磊,喻宗亮	100亿以上	外贸信托-星石优粤10号2期	3.08%	-3.01%	-8.56%	-8.56%	19.59%	7.94%	27.88%	0.42	0.28	
中欧瑞博	吴伟志	100亿以上	中欧瑞博赤兔一期	2.99%	-0.49%	-8.87%	-8.87%	15.96%	13.24%	22.24%	0.85	0.59	
海南大椿私募	支东兴,马腾	5~10亿	大椿鲁班一号	2.94%	1.85%	0.11%	0.11%	14.99%	30.86%	21.29%	1.14	1.44	
申九资产	朱晓亮	20~50亿	申九积极进取1号	2.94%	-3.28%	-1.92%	-1.92%	23.30%	11.21%	34.93%	0.51	0.32	
宽远资产	徐京德,梁力	100亿以上	宽远价值成长五期	2.92%	-0.30%	-5.18%	-5.18%	12.67%	12.90%	14.30%	0.89	0.90	
泽元投资	任文启	0~5亿	泽元元宝1号	2.89%	0.84%	10.10%	10.10%	9.47%	27.62%	18.75%	1.13	1.47	
中阅资本	刘安田	20~50亿	中阅新锐2号	2.86%	-2.17%	-11.72%	-11.72%	22.02%	6.99%	35.22%	0.34	0.19	
昭阳投资	方奎	0~5亿	昭阳1号	2.82%	-7.77%	3.00%	3.00%	32.23%	21.96%	54.70%	0.60	0.40	
少数派投资	周良	50~100亿	少数派8号	2.73%	-1.73%	-13.30%	-13.30%	21.96%	12.75%	36.08%	0.63	0.35	
仁桥资产	夏俊杰	100亿以上	仁桥泽源1期	2.66%	-2.44%	-1.56%	-1.56%	18.15%	16.87%	17.29%	1.10	0.97	
兆天投资	范迪钊	5~10亿	兆天金牛精选2号	2.65%	-2.96%	-20.68%	-20.68%	32.09%	12.65%	52.44%	0.51	0.24	
日斗投资	邹文	50~100亿	日斗牵牛价值一号	2.64%	1.47%	6.55%	6.55%	11.24%	27.78%	21.35%	0.97	1.30	
睿璞投资	蔡海洪	100亿以上	睿璞投资-睿洪一号	2.59%	-1.61%	0.18%	0.18%	9.39%	17.96%	40.95%	0.90	0.43	
百创资本	陈子仪	5~10亿	长牛分析全球一号	2.57%	1.81%	-2.02%	-2.02%	16.79%	9.42%	50.44%	0.43	0.18	
上海远策投资	张益驰,谢利	50~100亿	远策发现者	2.52%	-2.38%	-5.60%	-5.60%	18.73%	8.62%	37.61%	0.48	0.22	
福泽源(上海)私募	林前舵	20~50亿	泽源3号	2.47%	-1.89%	-12.16%	-12.16%	20.63%	12.41%	31.72%	0.67	0.39	
瀑布资管	卢强,孙左君	0~5亿	瀑布资产管理价值精选3期	2.45%	-1.83%	-6.00%	-6.00%	13.01%	9.84%	22.03%	0.54	0.44	
进化论资产	王一平	100亿以上	进化论复合策略一号	2.44%	-0.78%	-2.91%	-2.91%	10.86%	33.42%	27.06%	1.06	1.23	
广东德汇投资	郑琦鹏	50~100亿	德汇成长3期	2.43%	-3.15%	-4.31%	-4.31%	19.23%	9.86%	30.95%	0.40	0.31	

基金名称	基金经理	基金规模	基金策略	近1年收益率	近3个月收益率	近1个月收益率	近7日收益率	年化收益率	夏普比率	波动率	最大回撤	持仓集中度	行业分布
东恺投资	吴明义,李威	20~50亿	东恺新时代成长一号	2.43%	-0.50%	-9.25%	-9.25%	17.09%	12.98%	27.29%	0.65	0.47	
海南希瓦	梁宏	100亿以上	希瓦小牛1号	2.42%	0.53%	-3.16%	-3.16%	16.38%	28.77%	40.77%	1.12	0.70	
上海拾贝能信私募	胡建平	50~100亿	拾贝精选1期	2.41%	-0.80%	-3.13%	-3.13%	14.73%	8.95%	28.05%	0.52	0.31	
涌津投资	谢小勇	50~100亿	涌津涌赢11号	2.40%	-0.64%	-18.06%	-18.06%	26.14%	8.67%	33.84%	0.35	0.25	
上海禧弘	--	0~5亿	禧弘价值成长1号	2.38%	-2.00%	-0.33%	-0.33%	14.17%	6.94%	29.40%	0.36	0.23	
巨杉资产	齐东超	20~50亿	巨杉净值线3号	2.37%	-2.34%	-9.85%	-9.85%	18.65%	14.89%	40.46%	0.65	0.36	
钦沐资产	柳士威	5~10亿	钦沐创新生活	2.37%	-1.44%	3.25%	3.25%	21.76%	7.32%	41.16%	0.34	0.17	
睿郡资产	杜昌勇	100亿以上	睿郡5号	2.36%	-1.29%	1.12%	1.12%	11.39%	16.85%	13.43%	1.07	1.25	
青岛君厚私募	许治中	5~10亿	君厚知存价值共享	2.34%	-2.17%	-29.31%	-29.31%	30.92%	16.05%	31.95%	0.61	0.50	
格林施通	余军	20~50亿	大鹏湾财富三期	2.31%	-0.90%	-9.84%	-9.84%	26.02%	16.94%	43.76%	0.65	0.38	
上海汉鸿私募	杨正豪	0~5亿	汉盛晓希1号	2.25%	-0.36%	19.05%	19.05%	6.10%	21.18%	8.69%	1.32	2.43	
煜德投资	靳天珍	50~100亿	乐道成长优选2号A期	2.22%	-1.23%	-10.02%	-10.02%	17.64%	6.40%	35.38%	0.37	0.18	
上海白犀私募	李海	20~50亿	辛巴达母基金	2.02%	-0.29%	8.62%	8.62%	13.58%	26.11%	23.44%	1.08	1.11	
文多资产	范虎城	20~50亿	文多稳健一期	2.01%	-2.25%	2.84%	2.84%	11.93%	18.94%	16.40%	1.06	1.15	
聚鸣投资	刘晓龙	100亿以上	聚鸣多策略	2.00%	-1.81%	-10.59%	-10.59%	20.91%	21.81%	26.64%	0.94	0.81	
磐泽资产	张帆	50~100亿	磐泽扬帆稳健一号	1.84%	0.54%	4.23%	4.23%	15.77%	22.10%	32.97%	0.71	0.67	
明河投资	张翎	20~50亿	明河优质企业	1.71%	-1.90%	-8.19%	-8.19%	15.15%	16.26%	23.66%	0.86	0.68	
榕树投资	翟敬勇	10~20亿	榕树文明复兴四期	1.71%	-2.84%	-24.00%	-24.00%	31.18%	0.87%	51.66%	0.07	0.01	
上海大朴资产	刘华,朱烈,颜克益	100亿以上	中信信托-大朴进取1期	1.58%	-0.23%	-15.61%	-15.61%	21.21%	12.51%	30.53%	0.71	0.40	
丰琰投资	于江勇	5~10亿	丰琰中国优势一期	1.58%	-1.42%	-9.08%	-9.08%	15.43%	0.13%	34.99%	0.01	0.00	
博芮东方投资	张文斌	10~20亿	博芮东方价值1号	1.55%	-1.52%	-12.17%	-12.17%	21.80%	4.00%	33.09%	0.23	0.12	
上海仙人掌私募	姚跃	20~50亿	仙人掌盈洋远航一号	1.52%	-2.86%	0.09%	0.09%	16.88%	36.15%	37.98%	0.96	0.95	
青骊投资	刘淼	20~50亿	青骊长兴	1.48%	-3.10%	-16.45%	-16.45%	27.22%	19.30%	37.67%	0.83	0.51	
相聚资本	梁辉,王建东	100亿以上	相聚芒格一期	1.46%	-0.59%	-16.02%	-16.02%	24.59%	10.26%	35.39%	0.61	0.28	
资瑞兴投资	汪忠远	0~5亿	资瑞兴一号	1.31%	-0.33%	-0.42%	-0.42%	13.62%	17.06%	18.30%	0.94	0.93	
常春藤资产	石海慧	20~50亿	常春藤春竹	1.31%	-1.79%	-4.85%	-4.85%	23.21%	14.82%	34.38%	0.60	0.43	
仁布投资	李德亮	10~20亿	仁布积极进取1号	1.23%	-1.05%	-13.40%	-13.40%	17.75%	16.72%	29.34%	1.00	0.57	
名禹资产	陈美凤	20~50亿	名禹沐风1期	1.21%	-1.71%	-0.42%	-0.42%	16.97%	13.89%	16.97%	0.87	0.81	
健顺投资	吴晓威	20~50亿	健顺云2号	1.19%	-4.81%	-4.09%	-4.09%	29.24%	15.70%	46.25%	0.56	0.33	
盘京投资	庄涛	100亿以上	盘世1期	1.17%	0.51%	-10.77%	-10.77%	18.90%	14.03%	42.12%	0.65	0.33	
静实投资	郭亮	5~10亿	静实致远	1.15%	-0.91%	-3.34%	-3.34%	6.38%	14.67%	9.58%	1.30	1.53	
玄元投资	张震宇	100亿以上	玄元元丰21号	1.08%	-1.44%	5.46%	5.46%	15.39%	11.21%	15.39%	0.59	0.72	
丹羿投资	朱亮	20~50亿	丹羿-锐进1号	1.06%	-1.44%	-17.74%	-17.74%	23.30%	15.29%	38.74%	0.71	0.39	
石锋资产	郭锋	100亿以上	石锋资产大巧2号B	0.93%	0.16%	-26.73%	-26.73%	31.78%	10.43%	59.86%	0.46	0.17	
聚亿基金	张雷	0~5亿	聚亿凡旭	0.91%	-0.03%	-15.76%	-15.76%	26.72%	16.54%	26.72%	0.74	0.61	
庄贤投资	王安	10~20亿	庄贤锐进2号	0.79%	-1.17%	-18.24%	-18.24%	21.75%	22.53%	29.08%	1.14	0.77	
鼎萨投资	彭旭	5~10亿	鼎萨价值成长基金	0.76%	-6.87%	-2.34%	-2.34%	41.16%	15.60%	64.75%	0.52	0.24	
翼虎投资	余定恒	50~100亿	翼虎成长一期证券投资	0.73%	-2.36%	-3.98%	-3.98%	11.63%	8.67%	46.41%	0.40	0.18	
纵贯资本	金龙	10~20亿	纵贯稳健三号	0.72%	-0.48%	-3.65%	-3.65%	12.12%	-3.21%	12.12%	-0.55	-0.26	
远惟投资	王烁杰	10~20亿	远惟风雪2号	0.64%	-2.13%	-3.20%	-3.20%	23.27%	26.19%	23.27%	1.22	1.12	
复胜资产	陆航	50~100亿	复胜正能量一期	0.63%	0.66%	4.58%	4.58%	13.06%	29.36%	34.91%	0.88	0.84	
三希资本	张亮	5~10亿	三希赤霄一号	0.62%	-2.05%	-23.83%	-23.83%	30.04%	14.54%	48.67%	0.62	0.29	
华炎私募	卢准煌,方缈,李裕铭	0~5亿	华炎华迪B期	0.60%	-0.18%	13.48%	13.48%	3.32%	11.38%	4.55%	1.35	2.50	
海南融相私募	顾世勇	0~5亿	融相成长未来一号	0.57%	-0.74%	-20.54%	-20.54%	21.17%	11.95%	30.16%	0.50	0.39	
上海曜川私募	曾正香	5~10亿	曜川楚正进取一号	0.54%	-0.43%	-9.98%	-9.98%	13.90%	21.42%	22.45%	1.01	0.95	
一村投资	胡吉祥	100亿以上	一村源启2号	0.44%	0.64%	-19.58%	-19.58%	31.05%	22.25%	35.21%	0.53	0.63	
慈阳投资	史朝兴	0~5亿	慈阳投资进取1号	0.33%	-1.11%	-9.07%	-9.07%	10.57%	8.43%	18.83%	0.40	0.44	
沅洋投资	陆晓明	0~5亿	沅洋精选2号	0.27%	-0.34%	-26.86%	-26.86%	32.26%	14.13%	42.65%	0.50	0.34	

基金名称	基金经理	基金规模	基金策略	近1月	近3月	近6月	近1年	成立以来	成立以来	成立以来	成立以来	成立以来	成立以来
纽富斯投资	丁训刚,詹础,徐继强	10~20亿	纽富斯价值精选	0.21%	0.27%	-3.03%	-3.03%	6.69%	16.18%	15.55%	1.38	1.04	
博普科技	袁豪,何瑞琳	50~100亿	博普安泰2号A	0.18%	0.42%	12.32%	12.32%	13.15%	32.58%	27.57%	1.18	1.18	
禾永投资	顾义河,马哲峰	10~20亿	禾永尊享12号	0.09%	0.01%	2.03%	2.03%	2.14%	12.74%	3.82%	1.41	3.33	
善水源资产	刘明月	0~5亿	善水源价值成长5号	0.09%	0.00%	-23.19%	-23.19%	30.69%	1.24%	64.21%	0.12	0.01	
华银基金	张雄飞	10~20亿	华银稳健成长一号	0.01%	-0.12%	-14.97%	-14.97%	23.28%	5.08%	31.11%	0.28	0.16	
泾溪投资	赵乾明	20~50亿	泾溪中国优质成长3号	0.00%	-1.44%	-7.12%	-7.12%	8.75%	24.37%	18.68%	0.92	1.30	
远望角投资	曾实	20~50亿	远望角投资1期	-0.15%	0.69%	-0.77%	-0.77%	7.28%	15.37%	19.31%	0.83	0.79	
大华信安	齐靠民,张继荣	10~20亿	信安成长一号	-0.19%	-2.46%	10.19%	10.19%	8.33%	26.00%	25.66%	1.00	1.01	
易鑫资管	--	20~50亿	鑫安7期2号	-0.23%	-0.53%	-12.34%	-12.34%	16.53%	3.82%	33.38%	0.22	0.11	
证大资产	朱南松	20~50亿	证大天迪全价值对冲一号	-0.32%	-0.27%	3.10%	3.10%	25.87%	0.34%	57.30%	0.03	0.00	
东方港湾	但斌	100亿以上	东方港湾5号	-0.40%	2.41%	49.95%	49.95%	11.46%	9.98%	47.23%	0.45	0.21	
上海山樾树私募	陈静	10~20亿	山樾树二期	-0.43%	-2.71%	-18.54%	-18.54%	27.84%	10.37%	50.41%	0.46	0.20	
峰辰资产	刘华峰	0~5亿	峰辰长阳一号	-0.52%	-0.13%	-18.17%	-18.17%	23.29%	12.54%	43.63%	0.52	0.28	
望正资产	王鹏辉	100亿以上	望正基石投资一号	-1.47%	-3.86%	1.14%	1.14%	17.61%	15.78%	23.46%	0.78	0.67	

## 主观多头区间对比

今年以来收益		近1年收益		成立以来收益	
东方港湾 东方港湾5号		东方港湾 东方港湾5号		正圆投资 正圆壹号	
南土资产 五色土一期		南土资产 五色土一期		进化论资产 进化论复合...	
君之健投资 君之健翱翔...		君之健投资 君之健翱翔...		大禾投资 大禾投资掘金1号	
上海汉鸿私募 汉盛晓希1号		上海汉鸿私募 汉盛晓希1号		海南希瓦 希瓦小牛1号	
华炎私募 华炎华迪B期		华炎私募 华炎华迪B期		上海仙人掌私募 仙人掌...	
新思哲投资 新思哲成长...		新思哲投资 新思哲成长...		复胜资产 复胜正能量一期	
博普科技 博普安泰2号A		博普科技 博普安泰2号A		华安合鑫 华安合鑫稳健...	
神农投资 神农春晓		神农投资 神农春晓		龙航资产 龙航一期	
理成资产 理成圣远1号A期		理成资产 理成圣远1号A期		康曼德资本 康曼德003号	
奇盛基金 奇盛领航		奇盛基金 奇盛领航		大华信安 信安成长一号	
大华信安 信安成长一号		大华信安 信安成长一号		涌贝资产 涌贝阳光稳健	
泽元投资 泽元通宝1号		泽元投资 泽元通宝1号		远胜投资 远胜风雪2号	
涌贝资产 涌贝阳光稳健		涌贝资产 涌贝阳光稳健		上海曜川私募 曜川楚正...	
康曼德资本 康曼德003号		康曼德资本 康曼德003号		上海白犀私募 辛巴达母...	
上海白犀私募 辛巴达母...		上海白犀私募 辛巴达母...		巨曦资产 巨曦1号	
日斗投资 日斗犀牛价值...		日斗投资 日斗犀牛价值...		明河投资 明河优质企业	
玄元投资 玄元元丰21号		玄元投资 玄元元丰21号		文多资产 文多稳健一期	
复胜资产 复胜正能量一期		复胜资产 复胜正能量一期		格林施通 大鵬湾财富三期	
大禾投资 大禾投资掘金1号		大禾投资 大禾投资掘金1号		上海大朴资产 中信信托-...	
磐泽资产 磐泽扬帆稳健...		磐泽资产 磐泽扬帆稳健...		鼎萨投资 鼎萨价值成长...	
华安合鑫 华安合鑫稳健...		华安合鑫 华安合鑫稳健...		睿璞投资 睿璞投资-睿洪...	
软冰资产 软冰创新生活		软冰资产 软冰创新生活		翼虎投资 翼虎成长一期...	
证大资产 证大天迪全价...		证大资产 证大天迪全价...		巨杉资产 巨杉净值线3号	
昭阳投资 昭阳1号		昭阳投资 昭阳1号		青骊投资 青骊长兴	
文多资产 文多稳健一期		文多资产 文多稳健一期		资瑞兴投资 资瑞兴一号	
禾永投资 禾永尊享12号		禾永投资 禾永尊享12号		望正资产 望正基石投资...	
望正资产 望正基石投资...		望正资产 望正基石投资...		远望角投资 远望角投资1期	
睿郡资产 睿郡5号		睿郡资产 睿郡5号		健顺投资 健顺云2号	
睿璞投资 睿璞投资-睿洪...		睿璞投资 睿璞投资-睿洪...		常春藤资产 常春藤春竹	
海南大椿私募 大椿鲁班...		海南大椿私募 大椿鲁班...		上海仙人掌私募 仙人掌...	
上海仙人掌私募 仙人掌...		上海仙人掌私募 仙人掌...		博普科技 博普安泰2号A	
佳岳私募 佳岳-实投1号		佳岳私募 佳岳-实投1号		庄贤投资 庄贤锐进2号	
上海禧弘 禧弘价值成长1号		上海禧弘 禧弘价值成长1号		聚鸣投资 聚鸣多策略	
资瑞兴投资 资瑞兴一号		资瑞兴投资 资瑞兴一号		新思哲投资 新思哲成长...	
名禹资产 名禹沐风1期		名禹资产 名禹沐风1期		神农投资 神农春晓	
璟恒投资 璟恒德弘		璟恒投资 璟恒德弘		少数派投资 少数派8号	
远望角投资 远望角投资1期		远望角投资 远望角投资1期		昭阳投资 昭阳1号	
仁桥资产 仁桥泽源1期		仁桥资产 仁桥泽源1期		理成资产 理成圣远1号A期	
申九资产 申九积极进取1号		申九资产 申九积极进取1号		日斗投资 日斗犀牛价值...	
百创资本 长牛分析全球...		百创资本 长牛分析全球...		中欧瑞博 中欧瑞博亦免...	
鼎萨投资 鼎萨价值成长...		鼎萨投资 鼎萨价值成长...		兆天投资 兆金牛牛精选2号	
潼骛投资 潼骛致远1号		潼骛投资 潼骛致远1号		彤源投资 彤源同庆3号	
进化论资产 进化论复合...		进化论资产 进化论复合...		名禹资产 名禹沐风1期	
和谐汇一资产 和谐汇一...		和谐汇一资产 和谐汇一...		泽元投资 泽元通宝1号	
纽富斯投资 纽富斯价值...		纽富斯投资 纽富斯价值...		仁桥资产 仁桥泽源1期	
上海拾贝能信私募 拾贝...		上海拾贝能信私募 拾贝...		一村投资 一村源启2号	
海南希瓦 希瓦小牛1号		海南希瓦 希瓦小牛1号		泾溪投资 泾溪中国优质...	
远胜投资 远胜风雪2号		远胜投资 远胜风雪2号		宽远资产 宽远价值成长...	
静实投资 静实致远		静实投资 静实致远		弘尚资产 国联安-弘尚资...	
纵贯资本 纵贯稳健三号		纵贯资本 纵贯稳健三号		泓澄投资 泓澄投资	
翼虎投资 翼虎成长一期...		翼虎投资 翼虎成长一期...		君之健投资 君之健翱翔...	
健顺投资 健顺云2号		健顺投资 健顺云2号		远信投资 中信资本中国...	
广东德汇投资 德汇成长3期		广东德汇投资 德汇成长3期		仁布投资 仁布积极进取1号	
龙航资产 龙航一期		龙航资产 龙航一期		福泽源(上海)私募 泽源3号	
常春藤资产 常春藤春竹		常春藤资产 常春藤春竹		睿郡资产 睿郡5号	



## 二、量化多头：

### 1、中证500指增-超额收益分析（几何）

数据截至：2023-12-29

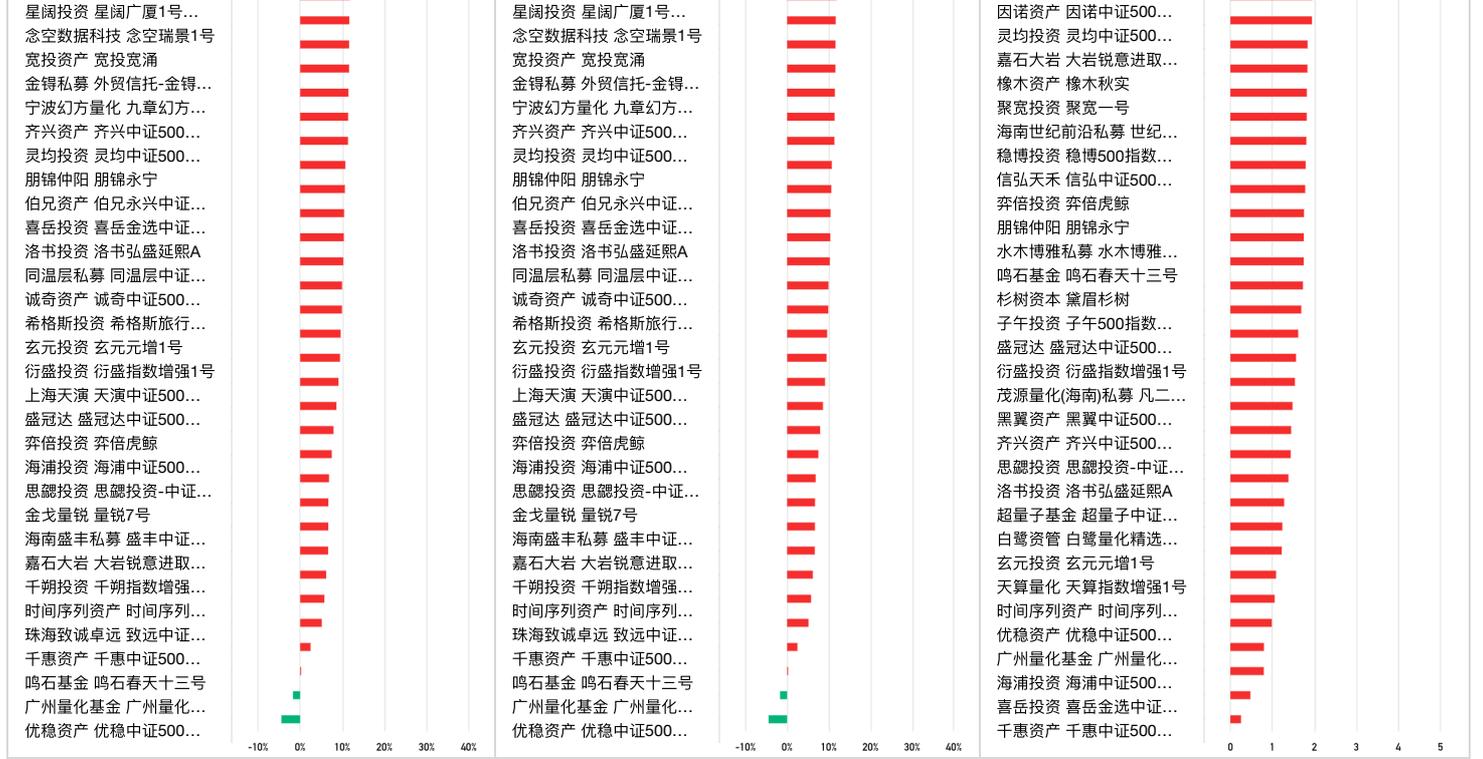
中证500			2.21% -2.53% -7.42% -7.42% 18.66%					--						
管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	本周超额	区间表现				成立以来				业绩走势图 (成立以来)	
					本周收益	上周收益	今年来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率		卡玛比率
优稳资产	李劲, 彭伟, 王骏	0~5亿	优稳中证500指数增强一号	2.35%	4.61%	-3.74%	-11.54%	-11.54%	28.20%	14.86%	28.20%	0.71	0.52	
黑翼资产	--	100亿以上	黑翼中证500指数增强专享1号	1.49%	3.74%	-2.29%	5.50%	5.50%	8.85%	17.87%	26.63%	0.93	0.67	
广州量化基金	朱仁杰	0~5亿	广州量化智强1号中证500增强	1.29%	3.53%	-2.45%	-8.99%	-8.99%	22.01%	13.91%	36.07%	0.54	0.38	
顽岩资产	--	100亿以上	顽岩中证500指数增强1号	0.72%	2.95%	-2.26%	5.67%	5.67%	11.04%	11.65%	20.30%	0.56	0.57	

基金名称	基金经理	基金规模	基金策略	近1月	近3月	近6月	近1年	近2年	近3年	近5年	近10年	近15年	近20年	近30年
洛书投资	谢冬	50~100亿	洛书弘盛延熙A	0.70%	2.93%	-2.43%	2.18%	2.18%	13.40%	12.23%	28.15%	0.65	0.43	
金锴私募	--	100亿以上	外贸信托-金锴上达中证500指数增强1期	0.70%	2.93%	-2.73%	3.31%	3.31%	11.31%	9.74%	21.43%	0.54	0.45	
喜岳投资	周欣	50~100亿	喜岳金选中证500指数增强1号	0.66%	2.88%	-2.03%	2.24%	2.24%	10.93%	3.81%	19.61%	0.22	0.19	
鸣石基金	王晓晗	100亿以上	鸣石春天十三号	0.65%	2.88%	-3.07%	-7.21%	-7.21%	18.15%	15.26%	37.67%	0.69	0.40	
巨量均衡基金	程志田	0~5亿	巨量均衡中证500进取型指数增强飒露紫一号	0.59%	2.81%	-2.17%	14.61%	14.61%	7.81%	5.56%	16.39%	0.31	0.33	
海浦投资	张均备	10~20亿	海浦中证500指数增强2号	0.57%	2.80%	-2.39%	-0.48%	-0.48%	13.67%	14.33%	42.68%	0.64	0.33	
盛冠达	黄灿	50~100亿	盛冠达中证500指数增强1号	0.56%	2.79%	-2.02%	0.55%	0.55%	14.16%	11.30%	26.67%	0.55	0.42	
钧富投资	王家栋, 戴杭骁	20~50亿	钧富如风靖戈102号	0.56%	2.79%	-2.79%	15.05%	15.05%	10.23%	14.81%	20.48%	0.81	0.72	
因诺资产	徐书楠, 沈星尧	100亿以上	因诺中证500指数增强2号	0.52%	2.75%	-2.42%	21.02%	21.02%	5.93%	25.18%	31.78%	1.07	0.79	
锐天投资	徐晓波	100亿以上	麦克斯韦一号	0.52%	2.75%	-2.16%	9.09%	9.09%	7.00%	20.58%	19.85%	0.97	1.03	
弈倍投资	余建国, 汤昕烨	10~20亿	弈倍虎鲸	0.50%	2.73%	-2.67%	-0.09%	-0.09%	13.39%	12.25%	27.32%	0.61	0.44	
思懿投资	陈磐颖	100亿以上	思懿投资-中证500指数增强1号	0.48%	2.70%	-2.29%	-1.08%	-1.08%	14.30%	24.51%	14.50%	1.18	1.69	
水木博雅私募	张成山	0~5亿	水木博雅中证500指数增强2号	0.46%	2.68%	-2.71%	6.68%	6.68%	10.60%	3.60%	14.52%	0.19	0.24	
衍复投资	高亢	100亿以上	衍复指增三号	0.43%	2.65%	-2.05%	11.30%	11.30%	7.94%	20.97%	16.74%	1.11	1.25	
茂源量化(海南)...	郭学文	100亿以上	凡二英火5号	0.42%	2.64%	-2.39%	3.66%	3.66%	10.46%	15.05%	23.60%	0.76	0.63	
卓识投资	张卓	100亿以上	卓识伟业	0.39%	2.62%	-2.03%	6.82%	6.82%	8.80%	17.29%	19.84%	0.96	0.87	
佳期投资	吴霄霄	100亿以上	佳期证星一期	0.37%	2.59%	-2.59%	5.24%	5.24%	10.36%	11.57%	19.74%	0.75	0.58	
嘉石大岩	黄铂	10~20亿	大岩锐意进取A类份额	0.36%	2.59%	-2.44%	-1.27%	-1.27%	10.80%	15.66%	24.04%	0.77	0.65	
白鹭资管	张晨樱	50~100亿	白鹭量化精选鲲鹏一号	0.36%	2.58%	-2.44%	4.90%	4.90%	9.73%	12.60%	19.61%	0.62	0.64	
量派投资	孙林	20~50亿	量派聚核20号	0.36%	2.58%	-2.78%	13.34%	13.34%	8.55%	13.75%	15.28%	0.71	0.89	
衍盛投资	章友	50~100亿	衍盛指数增强1号	0.35%	2.57%	-2.18%	1.34%	1.34%	13.88%	13.68%	23.12%	0.62	0.59	
金戈量锐	金戈	100亿以上	量锐7号	0.34%	2.56%	-2.71%	-1.22%	-1.22%	14.15%	18.72%	24.52%	0.95	0.76	
明泓投资	裘慧明, 解环宇	100亿以上	明泓价值成长1期	0.33%	2.55%	-2.40%	6.57%	6.57%	8.49%	18.90%	23.65%	0.94	0.79	
宁波幻方量化	徐进	100亿以上	九章幻方中证500量化多策略1号	0.32%	2.54%	-1.83%	3.19%	3.19%	10.07%	20.40%	34.55%	0.95	0.59	
龙旗科技	朱晓康	50~100亿	龙旗红旭	0.31%	2.53%	-2.68%	9.76%	9.76%	9.92%	15.09%	32.06%	0.71	0.47	
灵均投资	马志宇	100亿以上	灵均中证500指数增强2号	0.29%	2.51%	-2.62%	3.08%	3.08%	11.20%	21.12%	29.86%	0.99	0.70	
九坤投资	姚齐聪	100亿以上	九坤日享中证500指数增强1号	0.27%	2.49%	-2.27%	12.67%	12.67%	7.90%	18.86%	28.91%	0.86	0.65	
宽德私募	徐御之	100亿以上	宽德金选中证500指数增强6号	0.24%	2.45%	-2.29%	15.80%	15.80%	9.97%	23.29%	20.49%	1.11	1.13	
诚奇资产	何文奇	100亿以上	诚奇中证500增强精选1期	0.24%	2.46%	-2.63%	1.78%	1.78%	11.51%	12.43%	21.26%	0.67	0.58	
稳博投资	殷陶	100亿以上	稳博500指数增强多策略1号A类	0.23%	2.45%	-2.90%	5.58%	5.58%	9.67%	11.80%	29.87%	0.63	0.39	
希格斯投资	朱星星	20~50亿	希格斯旅行者1号	0.22%	2.44%	-2.26%	1.77%	1.77%	13.04%	15.82%	29.10%	0.85	0.54	
珠海致诚卓远	史帆	100亿以上	致远中证500指数加强	0.21%	2.43%	-1.37%	-2.67%	-2.67%	12.46%	17.03%	26.87%	0.90	0.63	
赫富投资	蔡觉逸	20~50亿	赫富500指数增强一号	0.17%	2.39%	-2.18%	4.03%	4.03%	10.57%	19.62%	27.49%	0.90	0.71	
念空数据科技	王丽	50~100亿	念空瑞景1号	0.15%	2.36%	-3.08%	3.38%	3.38%	10.31%	20.60%	22.28%	0.99	0.92	
前海博普资产	--	50~100亿	博普万维指数增强1号A类份额	0.13%	2.35%	-2.95%	4.87%	4.87%	8.58%	4.67%	8.58%	0.36	0.54	
海南世纪前沿私募	周志豪	100亿以上	世纪前沿指数增强2号	0.10%	2.31%	-2.71%	7.68%	7.68%	8.09%	23.34%	27.11%	1.05	0.86	
信弘天禾	章毅	100亿以上	信弘中证500指数增强1号	0.09%	2.30%	-2.41%	5.54%	5.54%	10.18%	9.61%	19.23%	0.54	0.49	

海南盛丰私募	林子洋	5~10亿	盛丰中证500指数增强1号	0.07%	2.29%	-2.93%	-1.24%	-1.24%	14.10%	5.85%	14.10%	0.29	0.41	
朋锦仲阳	谢洪燕	20~50亿	朋锦永宁	0.06%	2.27%	-2.42%	2.50%	2.50%	13.05%	18.61%	19.69%	0.98	0.94	
宽投资产	严宓	50~100亿	宽投宽涌	0.05%	2.27%	-2.37%	3.33%	3.33%	12.32%	14.56%	25.29%	0.78	0.57	
天算量化	何天鹰	50~100亿	天算指数增强1号	0.04%	2.26%	-2.05%	9.68%	9.68%	8.22%	11.42%	27.75%	0.62	0.41	
子午投资	朱嘉琦	20~50亿	子午500指数增强定制一号	0.04%	2.25%	-2.44%	5.18%	5.18%	11.23%	2.03%	18.57%	0.11	0.10	
聚宽投资	高斯蒙	50~100亿	聚宽一号	0.03%	2.24%	-1.63%	6.88%	6.88%	8.89%	24.01%	26.27%	1.04	0.91	
伯兄资产	严寒	5~10亿	伯兄永兴中证500指数增强	0.02%	2.24%	-1.69%	2.40%	2.40%	10.24%	0.04%	14.45%	-0.00	0.00	
千惠资产	陈立玺	50~100亿	千惠中证500指数增强1号	0.00%	2.21%	-2.75%	-5.14%	-5.14%	15.88%	-7.31%	23.06%	-0.47	-0.31	
盛泉恒元	赵忠东, 包发	100亿以上	盛泉恒元中证500指数增强53号	-0.01%	2.20%	-1.92%	6.28%	6.28%	8.60%	8.41%	23.49%	0.47	0.35	
杉树资本	刘世伟	5~10亿	黛眉杉树	-0.03%	2.18%	-1.47%	11.62%	11.62%	8.72%	13.27%	25.00%	0.69	0.53	
星阔投资	--	20~50亿	星阔广厦1号中证500指数增强	-0.07%	2.14%	-2.29%	3.51%	3.51%	12.93%	7.73%	27.71%	0.39	0.27	
玄元投资	孔镇宁, 张青, 张伟	100亿以上	玄元元增1号	-0.08%	2.14%	-2.43%	1.48%	1.48%	11.41%	15.43%	26.12%	0.80	0.59	
千朔投资	黄辉	10~20亿	千朔指数增强二号	-0.08%	2.13%	-2.65%	-1.71%	-1.71%	11.81%	14.05%	23.42%	0.72	0.59	
超量子基金	张晓泉	10~20亿	超量子中证500增强2号	-0.09%	2.12%	-2.66%	9.78%	9.78%	9.01%	0.39%	27.33%	0.03	0.01	
启林投资	王鸿勇	100亿以上	启林正兴东绣1号	-0.12%	2.09%	-2.99%	3.81%	3.81%	9.21%	18.67%	26.13%	0.93	0.71	
同温层私募	王林海, 段海磊	20~50亿	同温层中证500指数增强1号	-0.13%	2.08%	-1.73%	2.07%	2.07%	12.92%	17.30%	23.55%	0.87	0.73	
时间序列资产	王英昊	0~5亿	时间序列中证500指数增强2号	-0.13%	2.08%	-2.17%	-2.09%	-2.09%	12.06%	1.54%	23.15%	0.08	0.06	
橡木资产	--	10~20亿	橡木秋实	-0.14%	2.07%	-2.71%	7.74%	7.74%	10.05%	24.28%	25.91%	1.16	0.93	
齐兴资产	霍楠	20~50亿	齐兴中证500指数增强1号证券投资	-0.18%	2.03%	-2.82%	3.12%	3.12%	10.77%	0.51%	13.72%	0.02	0.03	
上海天演	谢晓阳	100亿以上	天演中证500指数增强3号	-0.45%	1.76%	-2.87%	1.01%	1.01%	11.31%	18.76%	28.45%	0.84	0.65	
源晖投资	贾晓玮	20~50亿	源晖中证500指数增强	-0.82%	1.37%	-2.31%	13.08%	13.08%	6.11%	17.11%	17.07%	0.85	1.00	

## 中证500指数增强产品-超额收益（几何）对比：





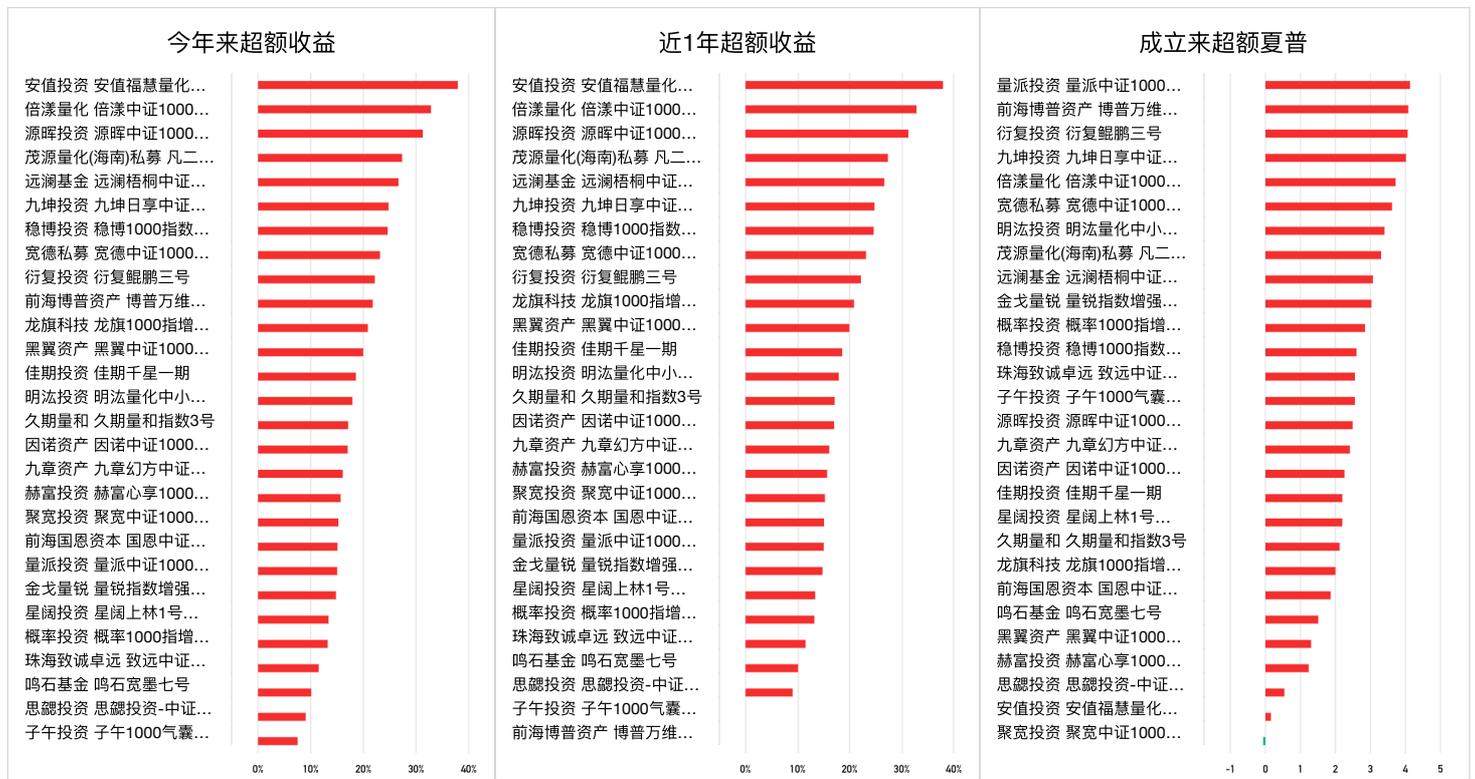
## 2、中证1000指增-超额收益分析（几何）

数据截至：2023-12-29

中证1000				2.67%	-3.66%	-6.28%	-6.28%	20.18%	--					
管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	本周超额	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
					本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	
前海国恩资本	何文领, 吴泾川	50~100亿	国恩中证1000指数增强1号	0.64%	3.34%	-3.29%	7.87%	7.87%	9.41%	17.84%	15.39%	0.87	1.15	
黑翼资产	--	100亿以上	黑翼中证1000指数增强1号B类份额	0.48%	3.17%	-2.39%	12.43%	12.43%	6.53%	5.18%	27.75%	0.27	0.18	
佳期投资	吴霄霄	100亿以上	佳期千星一期	0.39%	3.08%	-3.34%	11.13%	11.13%	11.50%	19.78%	21.46%	0.94	0.92	
倍漾量化	--	20~50亿	倍漾中证1000指数增强1期A类	0.38%	3.06%	-2.48%	24.49%	24.49%	5.71%	未满一年	5.71%	1.94	4.30	
因诺资产	徐书楠	100亿以上	因诺中证1000指数增强1号	0.31%	3.00%	-3.04%	9.67%	9.67%	9.29%	20.30%	32.62%	0.86	0.62	
鸣石基金	王晓晗	100亿以上	鸣石宽墨七号	0.25%	2.93%	-2.76%	3.20%	3.20%	13.54%	19.91%	37.45%	0.93	0.53	
衍复投资	高亢	100亿以上	衍复鲲鹏三号	0.25%	2.93%	-2.71%	14.50%	14.50%	7.34%	27.14%	20.40%	1.17	1.33	
明法投资	裘慧明, 解环宇	100亿以上	明法量化中小盘增强1号B份额	0.19%	2.87%	-3.79%	10.51%	10.51%	9.78%	32.30%	24.21%	1.32	1.33	
思懿投资	陈星豪	100亿以上	思懿投资-中证1000指数增强1号	0.12%	2.79%	-2.38%	2.21%	2.21%	14.69%	-2.10%	14.69%	-0.23	-0.14	
茂源量化(海南)...	郭学文	100亿以上	凡二量化中证1000增强1号	0.10%	2.77%	-2.22%	19.36%	19.36%	6.95%	13.50%	22.13%	0.61	0.61	
安值投资	于超	10~20亿	安值福慧量化10号	0.08%	2.76%	-2.35%	29.26%	29.26%	5.91%	5.29%	27.50%	0.30	0.19	
珠海致诚卓远	史帆	100亿以上	致远中证1000指数加强	0.04%	2.71%	-2.00%	4.54%	4.54%	10.54%	18.48%	25.43%	0.83	0.72	
九坤投资	姚齐聪	100亿以上	九坤日享中证1000指数增强1号	0.01%	2.69%	-2.92%	16.94%	16.94%	10.93%	30.19%	22.64%	1.27	1.33	
量派投资	孙林	20~50亿	量派中证1000增强12号	-0.02%	2.65%	-2.96%	7.81%	7.81%	10.90%	14.14%	25.76%	0.64	0.54	
稳博投资	殷陶	100亿以上	稳博1000指数增强1号B类	-0.03%	2.64%	-2.79%	16.79%	16.79%	7.46%	25.43%	22.11%	1.10	1.15	
聚宽投资	高斯蒙	50~100亿	聚宽中证1000指数增强1号	-0.16%	2.51%	-3.11%	8.02%	8.02%	10.68%	-2.93%	27.19%	-0.13	-0.10	
宽德私募	徐御之	100亿以上	宽德中证1000指数增强2号	-0.17%	2.50%	-2.95%	15.42%	15.42%	10.40%	9.19%	15.82%	0.42	0.58	
九章资产	陈哲	100亿以上	九章幻方中证1000量化多策略1号	-0.18%	2.49%	-2.16%	8.81%	8.81%	8.96%	32.05%	33.18%	1.31	0.96	

远澜基金	董致远	10~20亿	远澜梧桐中证1000指数增强B份额	-0.21%	2.46%	-1.50%	18.71%	18.71%	10.18%	12.21%	9.44%	0.67	1.29	
星阔投资	--	20~50亿	星阔上林1号中证1000指数增强	-0.30%	2.37%	-2.77%	6.27%	6.27%	12.65%	11.37%	31.67%	0.49	0.35	
金戈量锐	金戈	100亿以上	量锐指数增强1000一号	-0.35%	2.32%	-3.64%	7.59%	7.59%	12.07%	11.89%	25.06%	0.57	0.47	
赫富投资	蔡觉逸	20~50亿	赫富心享1000指数增强1号	-0.38%	2.29%	-2.75%	8.42%	8.42%	10.70%	6.41%	30.13%	0.30	0.21	
龙旗科技	朱晓康	50~100亿	龙旗1000指增1号B	-0.39%	2.27%	-3.50%	13.27%	13.27%	8.54%	5.16%	24.77%	0.26	0.20	
前海博普资产	袁豪	50~100亿	博普万维指数增强2号A类份额	-0.40%	2.26%	-3.52%	4.39%	4.39%	8.70%	未满一年	8.70%	0.45	0.66	
概率投资	杨曦	20~50亿	概率1000指增1号	-0.55%	2.11%	-2.96%	6.12%	6.12%	11.42%	13.12%	25.16%	0.57	0.52	
源晖投资	贾晓玮	20~50亿	源晖中证1000指数增强	-0.55%	2.11%	-2.29%	23.03%	23.03%	5.04%	10.85%	16.77%	0.54	0.64	
久期量和	程建涛	10~20亿	久期量和指数3号	-0.84%	1.81%	-2.40%	9.77%	9.77%	8.77%	12.78%	28.31%	0.61	0.45	
子午投资	谢兰	20~50亿	子午1000气囊指数增强五号	-1.20%	1.44%	-2.40%	4.13%	4.13%	4.52%	未满一年	4.52%	--	--	

### 中证1000指数增强产品-超额收益（几何）对比：



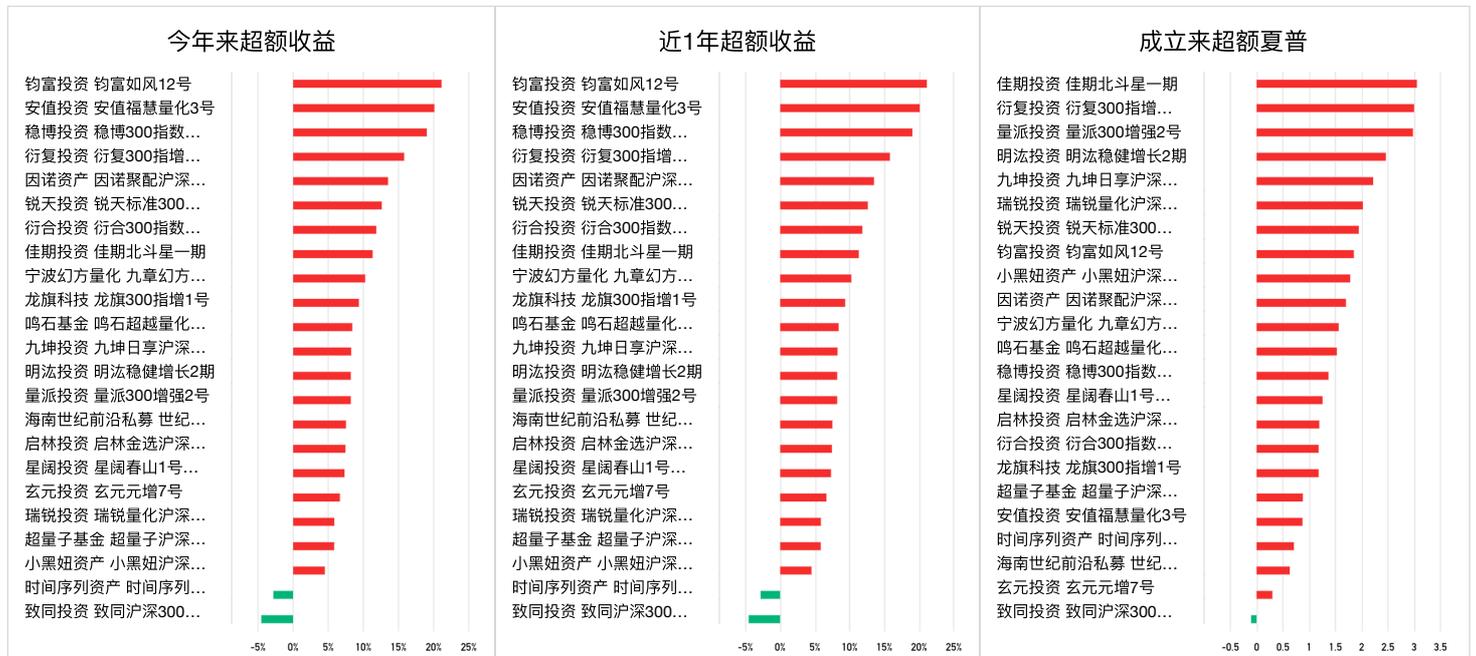
### 3、沪深300指增-超额收益分析（几何）

数据截至：2023-12-29

沪深300				2.81%	-0.13%	-11.38%	-11.38%	21.51%	--					
管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	本周超额	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
					本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	
明法投资	裘慧明, 解环宇	100亿以上	明法稳健增长2期	0.36%	3.18%	0.07%	-4.10%	-4.10%	14.60%	14.08%	24.09%	0.74	0.58	
佳期投资	吴霄霄	100亿以上	佳期北斗星一期	0.34%	3.17%	-0.70%	-1.35%	-1.35%	16.08%	22.93%	16.08%	1.27	1.42	
小黑妞资产	杜仁华, 康小卫	10~20亿	小黑妞沪深300指数增强1号	0.30%	3.13%	0.25%	-7.39%	-7.39%	17.37%	6.44%	26.46%	0.34	0.24	
鸣石基金	--	100亿以上	鸣石超越量化指数增强1A号	0.24%	3.06%	-1.02%	-3.92%	-3.92%	12.83%	0.66%	22.96%	0.01	0.02	
启林投资	王鸿勇	100亿以上	启林金选沪深300指增1号	0.13%	2.94%	-0.75%	-4.77%	-4.77%	13.56%	-7.71%	25.11%	-0.50	-0.30	
九坤投资	姚齐聪	100亿以上	九坤日享沪深300指数增强1号	0.10%	2.92%	-0.66%	-4.06%	-4.06%	13.77%	11.30%	21.25%	0.63	0.53	

钧富投资	王家栋, 戴杭骁	20~50亿	钧富如风12号	0.10%	2.91%	-0.60%	7.34%	7.34%	10.71%	5.85%	20.49%	0.33	0.28	
量派投资	孙林	20~50亿	量派300增强2号	0.01%	2.82%	-0.33%	-4.11%	-4.11%	14.15%	-1.85%	23.80%	-0.14	-0.07	
因诺资产	徐书楠	100亿以上	因诺聚配沪深300指数增强	-0.06%	2.75%	-0.91%	0.60%	0.60%	13.81%	14.47%	29.44%	0.71	0.49	
衍复投资	高亢	100亿以上	衍复300指增一号	-0.08%	2.73%	-0.65%	2.62%	2.62%	11.55%	-0.47%	18.86%	-0.06	-0.02	
时间序列资产	王英昊	0~5亿	时间序列沪深300指数增强1号	-0.19%	2.62%	-0.41%	-13.87%	-13.87%	21.60%	-9.89%	34.06%	-0.60	-0.29	
安值投资	于超	10~20亿	安值福慧量化3号	-0.20%	2.61%	-0.86%	6.44%	6.44%	8.66%	8.49%	23.40%	0.45	0.36	
锐天投资	徐晓波	100亿以上	锐天标准300指数增强1号	-0.20%	2.61%	-0.70%	-0.19%	-0.19%	13.44%	9.82%	19.10%	0.60	0.51	
超量子基金	张晓泉, 詹焯扬	10~20亿	超量子沪深300增强1号	-0.22%	2.59%	-0.84%	-6.20%	-6.20%	15.96%	-2.84%	34.54%	-0.19	-0.08	
海南世纪前沿私募	吴敌	100亿以上	世纪前沿指数增强1号	-0.23%	2.58%	-0.72%	-4.71%	-4.71%	15.08%	5.26%	26.78%	0.32	0.19	
稳博投资	殷陶	100亿以上	稳博300指数增强1号B	-0.24%	2.56%	-0.14%	5.49%	5.49%	12.42%	3.47%	28.13%	0.19	0.12	
龙旗科技	朱晓康	50~100亿	龙旗300指增1号	-0.27%	2.54%	-1.08%	-3.09%	-3.09%	16.72%	-6.26%	21.69%	-0.39	-0.28	
致同投资	李志强	10~20亿	致同沪深300指数增强一期	-0.30%	2.51%	0.64%	-15.39%	-15.39%	25.05%	-10.60%	37.78%	-0.66	-0.28	
衍合投资	汤亦多, 张磊	0~5亿	衍合300指数增强1号	-0.31%	2.49%	-1.25%	-0.90%	-0.90%	12.82%	-6.10%	22.76%	-0.45	-0.26	
玄元投资	孔镇宁, 商震, 张伟	100亿以上	玄元元增7号	-0.32%	2.48%	-0.24%	-5.48%	-5.48%	14.07%	-11.22%	26.62%	-0.73	-0.42	
瑞锐投资	袁磊	5~10亿	瑞锐量化沪深300	-0.55%	2.25%	0.75%	-6.19%	-6.19%	15.34%	3.96%	17.58%	0.21	0.22	
宁波幻方量化	徐进	100亿以上	九章幻方沪深300量化多策略1号	-0.59%	2.20%	-0.95%	-2.30%	-2.30%	13.47%	18.12%	33.86%	0.85	0.53	
星阔投资	邓剑	20~50亿	星阔春山1号沪深300指数增强	-0.87%	1.92%	-1.16%	-4.89%	-4.89%	14.38%	-5.34%	30.68%	-0.34	-0.17	

## 沪深300指数增强产品-超额收益（几何）对比：



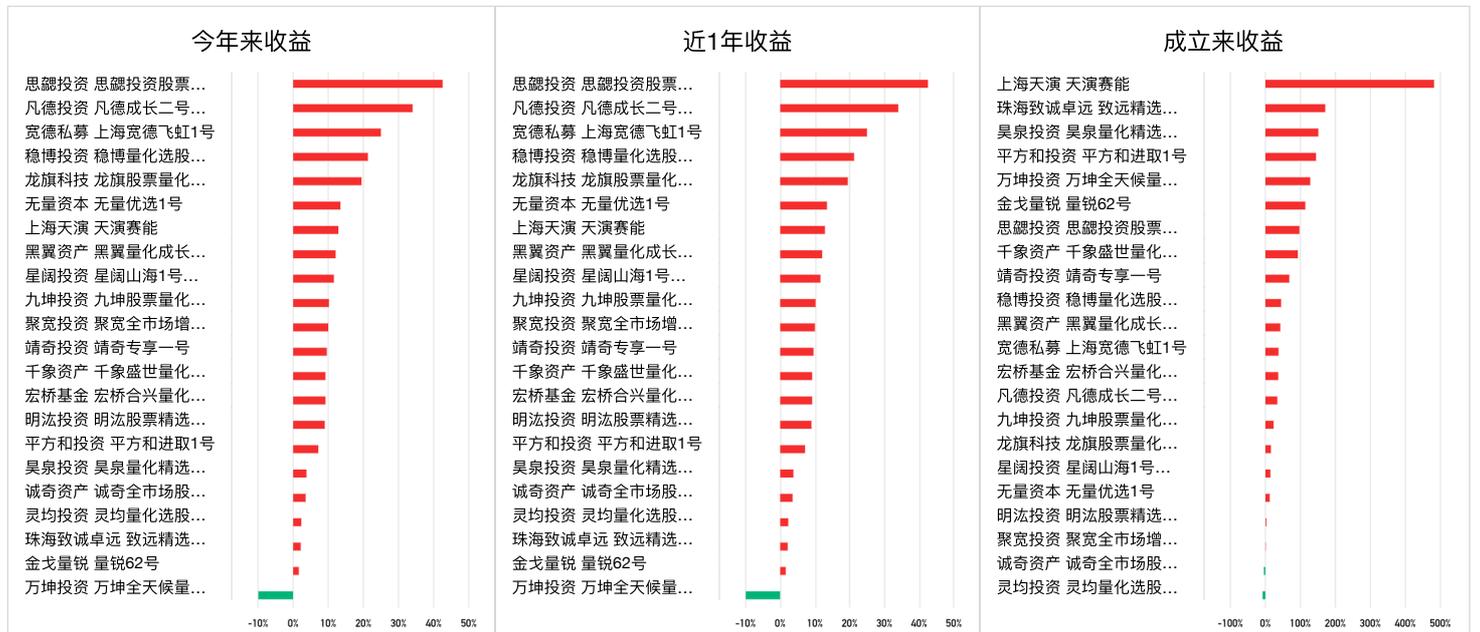
## 4、量化选股-收益回撤分析

数据截至：2023-12-29

中证800				2.65%	-0.79%	-10.37%	-10.37%	20.18%	--				
管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
				本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	

基金名称	基金经理	基金规模	策略名称	4.05%	-0.69%	-9.91%	-9.91%	20.33%	12.91%	30.57%	0.61	0.42	走势图
万坤投资	王云翔	5~10亿	万坤全天候量化1号	2.95%	-3.09%	2.33%	2.33%	12.47%	-3.35%	33.42%	-0.11	-0.10	
灵均投资	--	100亿以上	灵均量化选股领航尊享1号	2.74%	-2.46%	12.10%	12.10%	7.35%	12.88%	30.39%	0.65	0.42	
黑翼资产	--	100亿以上	黑翼量化成长1号B	2.69%	-2.07%	2.17%	2.17%	11.83%	19.94%	20.53%	0.93	0.97	
珠海致诚卓远	史帆	100亿以上	致远精选一号	2.64%	-1.99%	10.02%	10.02%	7.45%	0.41%	29.08%	0.03	0.01	
聚宽投资	高斯蒙	50~100亿	聚宽全市场增强一号	2.61%	-2.78%	24.99%	24.99%	9.39%	17.56%	15.47%	0.78	1.13	
宽德私募	徐御之	100亿以上	上海宽德飞虹1号	2.59%	-2.30%	10.20%	10.20%	7.95%	7.94%	28.01%	0.40	0.28	
九坤投资	王琛	100亿以上	九坤股票量化优选2号	2.57%	-2.59%	19.48%	19.48%	7.86%	6.55%	25.24%	0.31	0.25	
龙旗科技	朱晓康	50~100亿	龙旗股票量化多头1号	2.57%	-2.81%	3.57%	3.57%	12.24%	-2.04%	20.30%	-0.09	-0.10	
诚奇资产	何文奇	100亿以上	诚奇全市场股票增强1号	2.55%	-2.62%	21.29%	21.29%	7.64%	18.45%	10.10%	0.94	1.82	
稳博投资	殷陶	100亿以上	稳博量化选股匠心系列1号	2.46%	-1.10%	13.48%	13.48%	8.00%	3.80%	27.02%	0.21	0.14	
无量资本	朱自珍	5~10亿	无量优选1号	2.44%	-2.82%	7.17%	7.17%	9.71%	17.61%	24.88%	0.81	0.70	
平方和投资	吕杰勇	50~100亿	平方和进取1号	2.39%	-2.83%	1.61%	1.61%	14.58%	18.45%	26.80%	0.92	0.68	
金戈量锐	金戈	100亿以上	量锐62号	2.30%	-2.44%	9.21%	9.21%	9.71%	12.02%	20.30%	0.66	0.59	
千象资产	陈斌	100亿以上	千象盛世量化选股1号	2.30%	-2.87%	9.01%	9.01%	8.88%	1.20%	23.51%	0.08	0.05	
明泓投资	裘慧明	100亿以上	明泓股票精选谷秋1号	2.15%	-2.67%	11.60%	11.60%	8.39%	5.72%	24.90%	0.29	0.22	
星阔投资	--	20~50亿	星阔山海1号股票优选	2.08%	-1.03%	3.81%	3.81%	8.04%	26.35%	13.45%	1.23	1.95	
吴泉投资	游甘泉	0~5亿	吴泉量化精选一号B	1.98%	-3.23%	9.21%	9.21%	11.13%	14.94%	15.66%	0.69	0.95	
宏桥基金	--	5~10亿	宏桥合兴量化一号	1.82%	-0.17%	9.60%	9.60%	3.59%	10.35%	17.15%	0.82	0.60	
靖奇投资	范思奇	10~20亿	靖奇专享一号	1.68%	-3.28%	12.89%	12.89%	8.93%	25.88%	30.39%	0.85	0.85	
上海天演	--	100亿以上	天演赛能	1.44%	-1.87%	42.56%	42.56%	1.87%	31.84%	5.85%	3.23	5.44	
思颢投资	陈星豪	100亿以上	思颢投资股票量化精选2期	1.13%	-1.49%	34.00%	34.00%	8.98%	未满一年	8.98%	1.98	3.95	
凡德投资	陈尊德,李丽梅,高原源	0~5亿	凡德成长二号B类份额										

## 量化选股-多维度对比



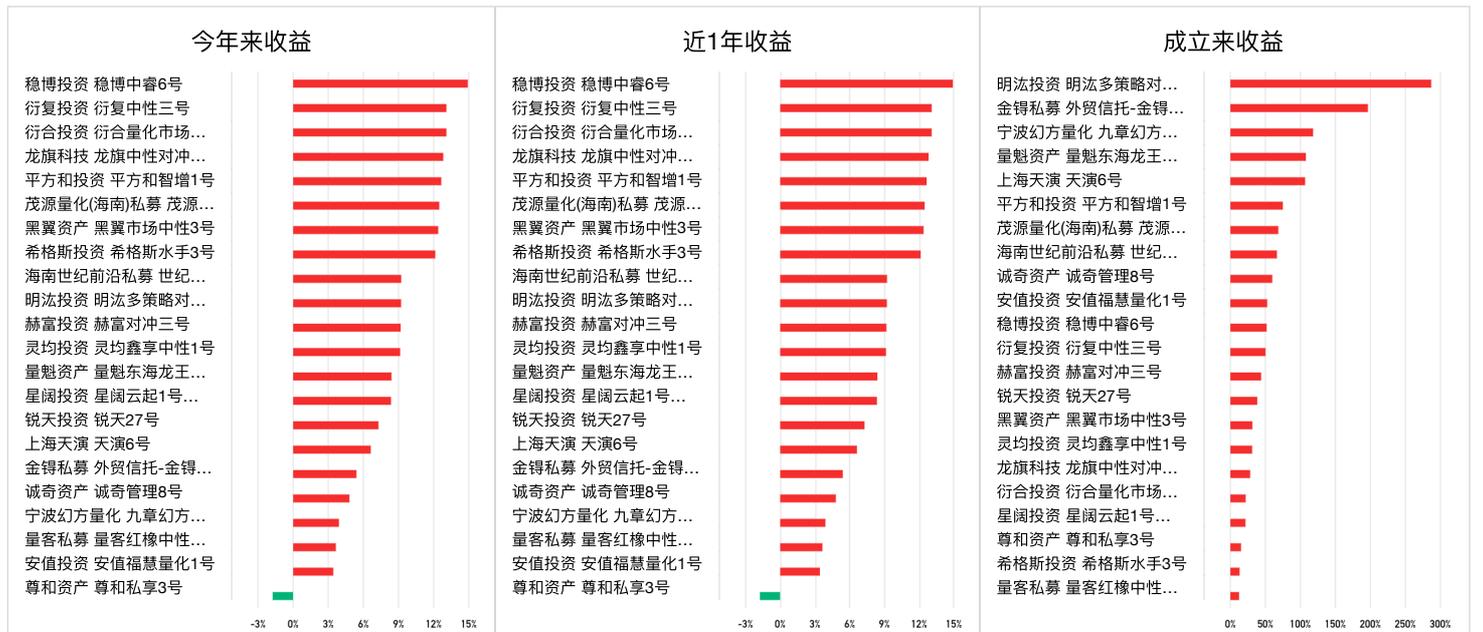
备注：超额收益计算方法，超额收益，又叫基金的相对收益，代表一定时间区间内，基金收益超出基准收益的部分。本报告采用超额收益(几何法)，具体计算方式如下： $超额收益(几何) = (基金收益 + 1) / (基准收益 + 1) - 1$

## 三、量化对冲-市场中性策略：

数据截至：2023-12-29

管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
				本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	
明泓投资	裘慧明,解环宇	100亿以上	明泓多策略对冲1号	1.40%	-0.12%	9.22%	9.22%	4.01%	17.00%	7.77%	1.65	2.18	
安值投资	于超	10~20亿	安值福慧量化1号	1.39%	-0.24%	3.43%	3.43%	3.60%	8.04%	7.92%	1.00	1.01	
锐天投资	徐晓波	100亿以上	锐天27号	0.84%	-0.58%	7.29%	7.29%	2.78%	6.81%	7.67%	0.88	0.88	
衍复投资	高亢	100亿以上	衍复中性三号	0.48%	-0.36%	13.09%	13.09%	1.30%	10.68%	6.08%	1.79	1.75	
衍合投资	汤亦多,张磊	0~5亿	衍合量化市场中性1号	0.40%	-0.12%	13.09%	13.09%	1.42%	6.10%	6.04%	0.90	1.00	
茂源量化(海南)私募	郭学文	100亿以上	茂源巴舍里耶2期	0.36%	-0.53%	12.48%	12.48%	1.24%	9.63%	6.65%	1.40	1.44	
宁波幻方量化	徐进	100亿以上	九章幻方量化对冲1号	0.31%	-0.20%	3.91%	3.91%	1.30%	12.08%	18.32%	1.35	0.65	
金锴私募	任思泓	100亿以上	外贸信托-金锴量化套利	0.30%	-0.76%	5.41%	5.41%	0.76%	10.43%	10.39%	1.42	1.00	
诚奇资产	何文奇	100亿以上	诚奇管理8号	0.19%	-0.71%	4.81%	4.81%	1.27%	7.72%	6.40%	1.19	1.20	
龙旗科技	朱晓康	50~100亿	龙旗中性对冲1号B	0.19%	-0.61%	12.82%	12.82%	1.57%	10.24%	7.54%	1.09	1.35	
希格斯投资	--	20~50亿	希格斯水手3号	0.19%	-0.35%	12.14%	12.14%	2.68%	5.16%	9.31%	0.57	0.55	
量魁资产	金枫杰,梁涛	20~50亿	量魁东海龙王二号	0.18%	-0.45%	8.40%	8.40%	1.90%	18.40%	4.58%	2.09	4.01	
黑翼资产	--	100亿以上	黑翼市场中性3号	0.16%	0.34%	12.39%	12.39%	2.24%	6.22%	7.73%	0.94	0.80	
灵均投资	马志宇	100亿以上	灵均鑫享中性1号	-0.05%	-0.71%	9.14%	9.14%	2.26%	9.26%	8.44%	1.08	1.09	
赫富投资	蔡觉逸	20~50亿	赫富对冲三号	-0.07%	-0.48%	9.18%	9.18%	1.64%	7.45%	11.21%	0.96	0.66	
平方和投资	吕杰勇	50~100亿	平方和智增1号	-0.08%	0.00%	12.65%	12.65%	1.23%	13.83%	10.19%	1.79	1.35	
海南世纪前沿私募	吴敌	100亿以上	世纪前沿量化对冲9号	-0.19%	-0.96%	9.23%	9.23%	1.58%	12.95%	8.86%	1.33	1.46	
尊和资产	刘连池,付嘉	5~10亿	尊和私享3号	-0.20%	-1.07%	-1.75%	-1.75%	3.76%	4.72%	4.39%	0.58	1.07	
上海天演	谢晓阳	100亿以上	天演6号	-0.26%	-0.77%	6.63%	6.63%	3.72%	10.93%	12.90%	1.39	0.84	
量客私募	李冬昕	20~50亿	量客红橡中性一号	-0.27%	-0.87%	3.65%	3.65%	1.96%	4.43%	6.61%	0.58	0.67	
星阔投资	--	20~50亿	星阔云起1号市场中性	-0.33%	-0.03%	8.36%	8.36%	1.67%	6.98%	7.89%	0.79	0.88	
稳博投资	殷陶	100亿以上	稳博中睿6号	-0.34%	-0.04%	14.92%	14.92%	2.07%	10.65%	4.31%	1.64	2.46	

## 量化对冲-市场中性多维度对比



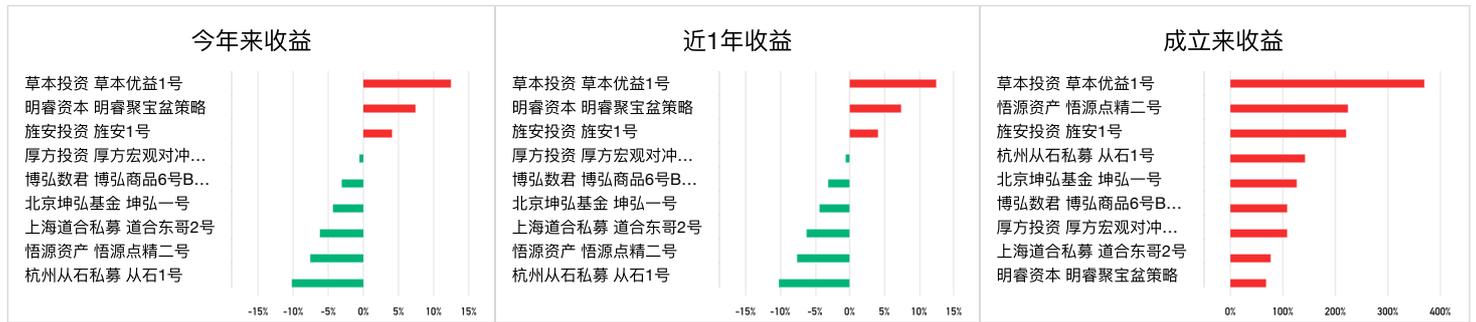
## 四、主观CTA:

数据截至: 2023-12-29

管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
				本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	

悟源资产	--	5~10亿	悟源点精二号	2.11%	1.75%	-7.56%	-7.56%	15.91%	21.62%	23.83%	0.80	0.90	
草本投资	曹登雷	0~5亿	草本优益1号	1.84%	2.04%	12.46%	12.46%	6.74%	33.82%	12.33%	1.18	2.74	
杭州从石私募	聂磊	10~20亿	从石1号	1.61%	1.05%	-10.18%	-10.18%	14.59%	22.98%	17.31%	1.07	1.32	
旌安投资	裘强强,郑辉,叶伟然	100亿以上	旌安1号	1.21%	-0.99%	4.08%	4.08%	3.51%	22.93%	6.03%	1.93	3.80	
博弘数君	--	0~5亿	博弘商品6号B类份额	0.90%	-0.79%	-3.08%	-3.08%	15.31%	20.13%	18.90%	0.87	1.06	
厚方投资	张家颖	10~20亿	厚方宏观对冲二号	0.68%	0.30%	-0.56%	-0.56%	13.26%	13.03%	13.26%	1.10	0.98	
明睿资本	高显明	10~20亿	明睿聚宝盆策略	0.03%	0.02%	7.41%	7.41%	8.03%	17.90%	25.28%	0.82	0.70	
上海道合私募	赵斌	5~10亿	道合东哥2号	0.00%	0.61%	-6.19%	-6.19%	9.90%	18.15%	19.19%	1.19	0.94	
北京坤弘基金	彭巍	0~5亿	坤弘一号	-0.29%	0.44%	-4.33%	-4.33%	13.35%	24.84%	14.36%	1.15	1.72	

## 主观CTA策略多维度对比:



## 五、量化CTA:

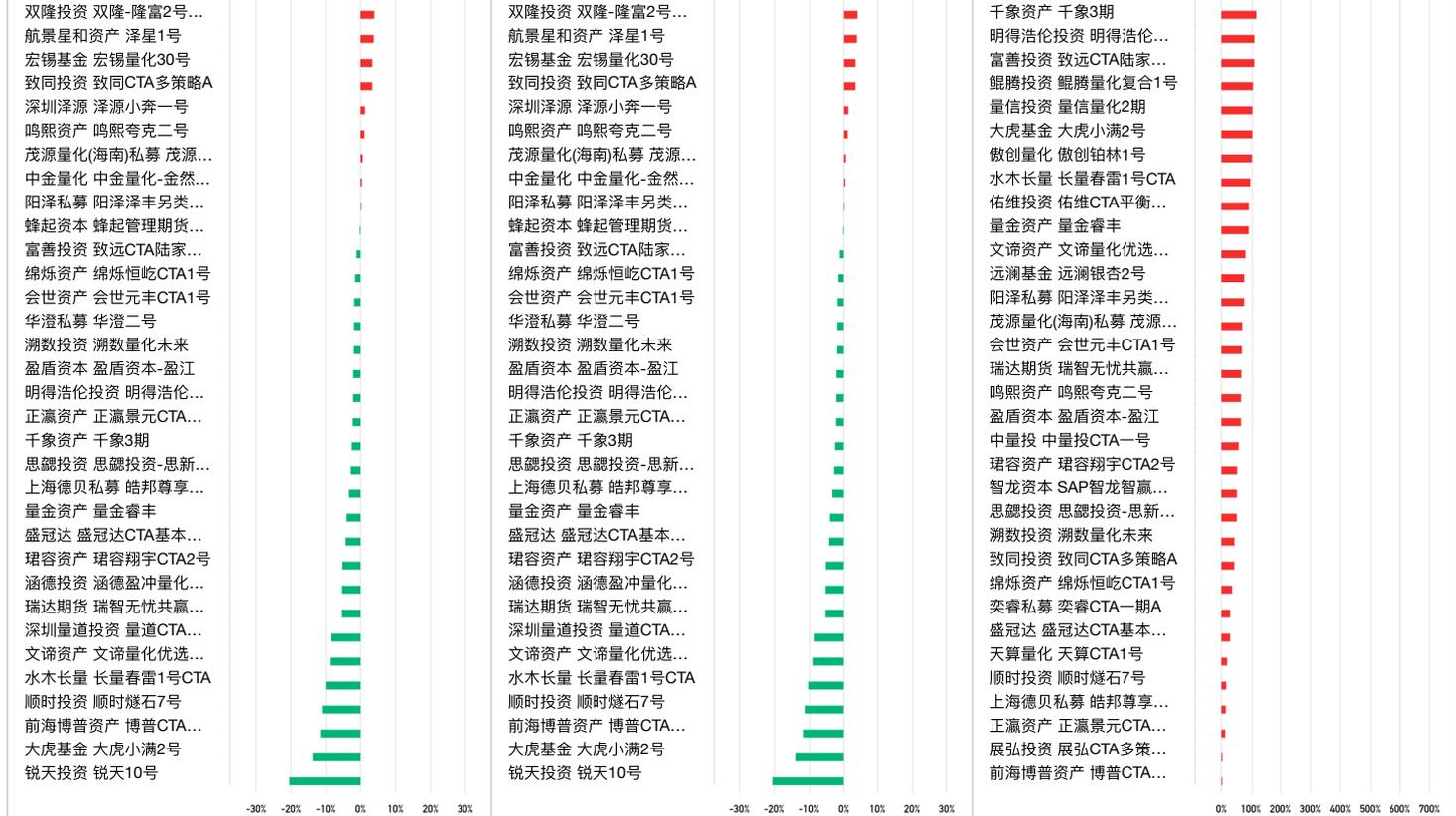
数据截至: 2023-12-29

管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
				本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	
易持资产	谢海权,张晓龙	5~10亿	易持龙腾天下	5.06%	1.80%	12.74%	12.74%	20.26%	31.48%	32.56%	0.91	0.96	
蜂起资本	潘錡宝,王琴,洪泽宇	0~5亿	蜂起管理期货一号	3.06%	-1.03%	-0.22%	-0.22%	11.07%	22.46%	21.85%	0.82	1.02	
量信投资	任重	0~5亿	量信量化2期	1.74%	-1.95%	8.67%	8.67%	8.62%	11.87%	32.67%	0.75	0.36	
前海博普资产	袁豪	50~100亿	博普CTA多策略2号1期	1.51%	0.17%	-11.59%	-11.59%	21.31%	1.05%	32.29%	0.05	0.03	
锐天投资	徐晓波	100亿以上	锐天10号	1.35%	2.39%	-20.46%	-20.46%	32.34%	16.64%	42.85%	0.65	0.38	
珺容资产	毛科技	20~50亿	珺容翔宇CTA2号	1.32%	-2.97%	-5.21%	-5.21%	7.34%	10.66%	23.61%	0.65	0.45	
阳泽私募	毛明	5~10亿	阳泽泽丰另类量化1号	1.27%	2.61%	0.18%	0.18%	5.21%	11.61%	11.42%	1.06	1.01	
绵烁资产	JIANG HAN	0~5亿	绵烁恒屹CTA1号	1.26%	0.14%	-1.59%	-1.59%	5.60%	9.27%	16.12%	0.56	0.57	
深圳量道投资	李文火,陈耀州	10~20亿	量道CTA精选1号	0.92%	-0.69%	-8.46%	-8.46%	19.33%	21.00%	36.57%	0.87	0.57	
华澄私募	颜学阶	0~5亿	华澄二号	0.87%	0.51%	-1.89%	-1.89%	13.27%	22.35%	37.15%	0.77	0.60	
中量投	董江文	20~50亿	中量投CTA一号	0.87%	-1.45%	4.09%	4.09%	5.84%	8.91%	9.16%	1.05	0.97	
因诺资产	徐书楠,刘恒一	100亿以上	因诺CTA1号	0.64%	-0.27%	24.71%	24.71%	4.17%	31.10%	6.74%	2.30	4.61	
智龙资本	赖成迪	0~5亿	SAP智龙智赢一号	0.62%	-1.12%	13.29%	13.29%	5.66%	10.58%	25.82%	0.73	0.40	
茂源量化(海南)私募	魏振宇	100亿以上	茂源资本经典CTA-2号	0.61%	-0.38%	0.60%	0.60%	7.30%	11.03%	15.50%	0.92	0.71	
会世资产	张议夫	20~50亿	会世元丰CTA1号	0.46%	0.04%	-1.83%	-1.83%	10.94%	10.13%	17.56%	0.95	0.57	
展弘投资	陈方府	100亿以上	展弘CTA多策略6号2期	0.38%	-0.53%	4.68%	4.68%	7.48%	1.57%	8.73%	0.04	0.17	
双隆投资	李隽	10~20亿	双隆-隆元1号	0.35%	-0.55%	6.19%	6.19%	5.08%	14.33%	8.20%	1.05	1.74	
中金量化	代绍礼	10~20亿	中金量化-金然稳健1号	0.29%	0.00%	0.39%	0.39%	3.58%	31.54%	9.69%	1.80	3.25	
百奕投资	李丹	0~5亿	百奕趋势力量化CTA	0.24%	-1.40%	7.70%	7.70%	6.16%	16.31%	15.33%	0.84	1.06	

双隆投资	李隽	10~20亿	双隆-隆富2号B类	0.19%	-0.50%	3.94%	3.94%	6.82%	14.14%	9.02%	1.12	1.56	
量金资产	沈卫平	0~5亿	量金睿丰	0.19%	0.01%	-4.02%	-4.02%	7.24%	13.36%	14.45%	0.93	0.92	
明得浩伦投资	孔令坤	0~5亿	明得浩伦CTA一号	0.10%	0.17%	-2.16%	-2.16%	4.98%	9.95%	15.27%	0.64	0.65	
傲创量化	陈冷希	0~5亿	傲创铂林1号	0.09%	0.09%	6.80%	6.80%	1.76%	13.67%	19.25%	0.73	0.71	
溯数投资	关宇颂,林文亮	0~5亿	溯数量化未来	0.08%	-0.35%	-1.94%	-1.94%	3.47%	8.50%	5.46%	1.11	1.55	
航景星和资产	李静	0~5亿	泽星1号	0.02%	-2.40%	3.77%	3.77%	7.49%	35.07%	31.02%	0.92	1.13	
鲲鹏投资	刘亮	10~20亿	鲲鹏量化复合1号	0.00%	-0.33%	8.53%	8.53%	7.49%	21.64%	30.67%	0.93	0.70	
均成资产	司维	50~100亿	均成CTA1号	-0.11%	-0.22%	14.64%	14.64%	11.18%	33.41%	22.47%	1.38	1.48	
佑维投资	王思达,龚晓雨,王昊彦	10~20亿	佑维CTA平衡一号	-0.15%	-0.73%	17.34%	17.34%	4.25%	15.91%	8.38%	1.41	1.89	
上海德贝私募	马俊	20~50亿	皓邦尊享CTA1号	-0.24%	-0.57%	-3.34%	-3.34%	7.51%	4.66%	14.31%	0.34	0.32	
毓颜投资	陈家祥,丁启书	0~5亿	毓颜言商1号	-0.30%	1.54%	9.67%	9.67%	9.43%	17.22%	17.03%	0.94	1.01	
天算量化	何天鹰	50~100亿	天算CTA1号	-0.33%	0.76%	10.27%	10.27%	3.52%	6.52%	36.17%	0.30	0.18	
顺时投资	韩广宇	10~20亿	顺时燧石7号	-0.35%	-0.70%	-11.08%	-11.08%	12.02%	3.53%	32.69%	0.22	0.10	
盛冠达	黄灿,余浩	50~100亿	盛冠达CTA基本面量化1号	-0.36%	0.81%	-4.28%	-4.28%	7.21%	5.57%	19.33%	0.47	0.28	
涵德投资	秦志宇,顾小军	50~100亿	涵德盈冲量化CTA1号	-0.42%	0.29%	-5.30%	-5.30%	7.20%	22.08%	9.72%	1.41	2.27	
千象资产	陈斌	100亿以上	千象3期	-0.43%	-0.60%	-2.55%	-2.55%	5.85%	9.73%	10.34%	0.79	0.94	
鸣熙资产	张祥方	10~20亿	鸣熙夸克二号	-0.45%	-0.85%	1.10%	1.10%	7.38%	10.78%	13.85%	0.90	0.77	
富善投资	傅娟,章恩	10~20亿	致远CTA陆家嘴精选1期	-0.53%	-0.61%	-1.19%	-1.19%	10.05%	10.42%	17.99%	0.93	0.57	
旭诺资产	罗晨	5~10亿	旭诺CTA一号	-0.62%	0.17%	13.52%	13.52%	3.04%	14.73%	12.33%	1.00	1.19	
远澜基金	王凯	10~20亿	远澜云杉	-0.63%	-0.32%	3.95%	3.95%	1.64%	13.55%	14.59%	1.23	0.92	
致同投资	吴巾帅	10~20亿	致同CTA多策略A	-0.76%	-0.25%	3.35%	3.35%	6.96%	12.47%	19.88%	0.61	0.62	
盈盾资本	陈飞	0~5亿	盈盾资本-盈江	-0.90%	-0.24%	-2.13%	-2.13%	4.69%	12.96%	9.39%	1.14	1.38	
水木长量	--	0~5亿	长量春雷1号CTA	-0.91%	-2.17%	-10.09%	-10.09%	12.56%	18.06%	16.31%	0.77	1.10	
奕睿私募	李岸隆	0~5亿	奕睿CTA一期A	-1.00%	-0.31%	8.44%	8.44%	13.14%	13.58%	14.61%	0.81	0.92	
瑞达期货	黄青青	--	瑞智无忧共赢10号	-1.07%	-0.26%	-5.33%	-5.33%	13.01%	13.46%	17.08%	0.91	0.77	
与取投资	鲁轶	5~10亿	与取华山1号	-1.65%	1.17%	12.09%	12.09%	16.90%	24.65%	27.32%	0.89	0.90	
文谛资产	周时和	10~20亿	文谛量化优选三号	-1.67%	1.15%	-8.86%	-8.86%	9.30%	12.89%	12.17%	0.94	1.05	
远澜基金	王凯	10~20亿	远澜银杏2号	-2.15%	-1.06%	11.31%	11.31%	5.71%	14.76%	12.56%	0.92	1.17	
深圳泽源	覃宣植	10~20亿	泽源小奔一号	-2.24%	-0.71%	1.28%	1.28%	5.51%	44.45%	10.65%	1.45	4.17	
正瀛资产	杨钦澄	20~50亿	正瀛景元CTA一号	-2.42%	-0.17%	-2.25%	-2.25%	9.79%	4.06%	14.55%	0.29	0.27	
宏锡基金	刘锡斌	20~50亿	宏锡量化30号	-2.73%	0.24%	3.36%	3.36%	12.91%	23.14%	28.77%	0.89	0.80	
大虎基金	窦伟	0~5亿	大虎小满2号	-4.13%	-2.93%	-13.79%	-13.79%	28.36%	32.09%	28.36%	0.89	1.13	
思颯投资	陈星豪	100亿以上	思颯投资-思新四十七号	-7.39%	-4.60%	-2.82%	-2.82%	11.65%	9.89%	12.56%	0.86	0.78	

## 量化CTA策略多维度对比:





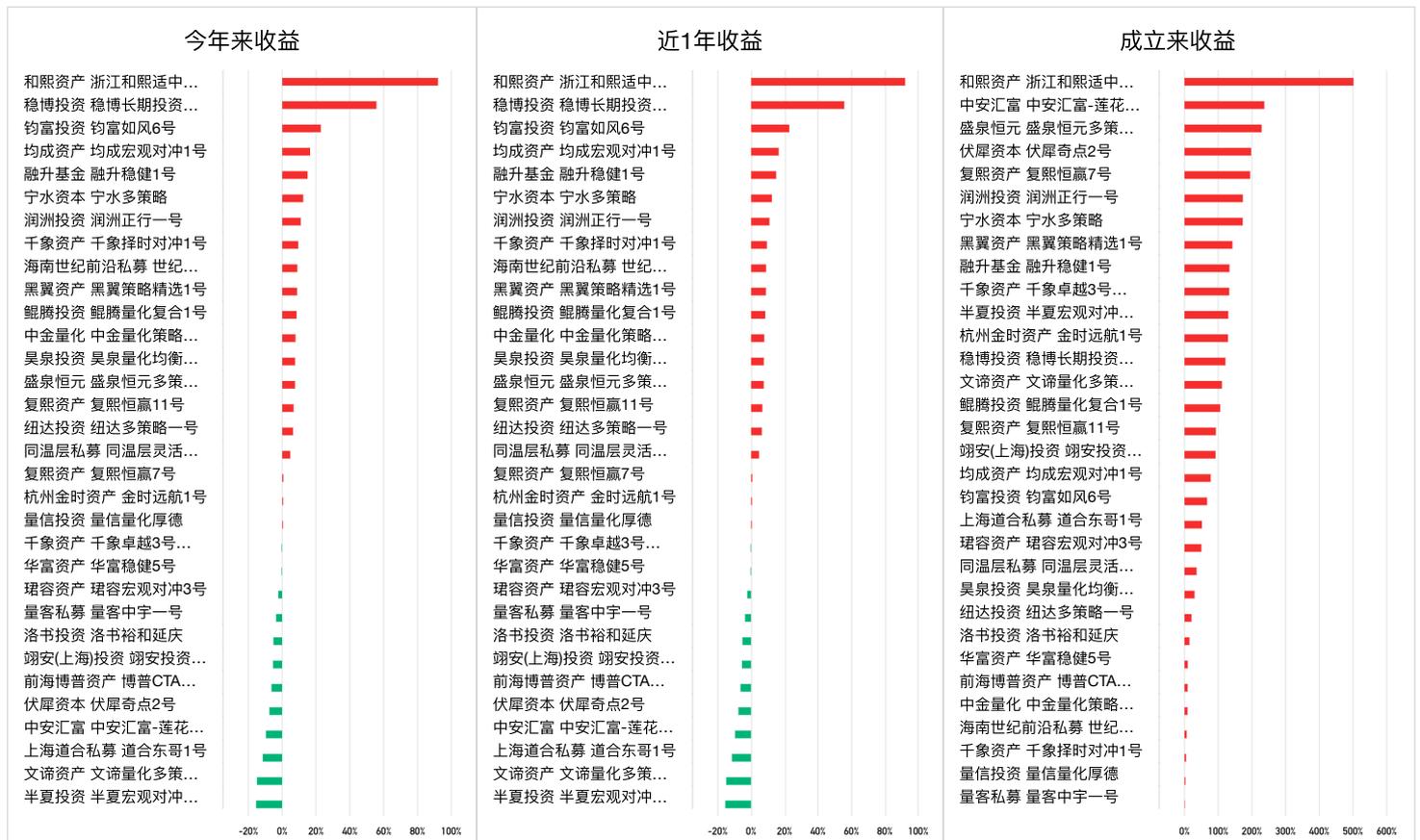
## 六、复合/宏观策略：

数据截至：2023-12-29

管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
				本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	
前海博普资产	--	50~100亿	博普CTA股票全市场一号	2.83%	-1.65%	-6.34%	-6.34%	22.62%	3.20%	32.71%	0.17	0.09	
纽达投资	邬雄辉	20~50亿	纽达多策略一号	2.52%	-1.09%	6.43%	6.43%	7.68%	6.75%	18.08%	0.41	0.37	
千象资产	--	100亿以上	千象择时对冲1号	2.47%	-2.34%	9.49%	9.49%	7.56%	2.32%	13.20%	0.12	0.17	
半夏投资	李蓓	100亿以上	半夏宏观对冲二期	2.41%	-1.79%	-15.44%	-15.44%	22.42%	17.09%	22.42%	0.99	0.76	
翊安(上海)投资	张惠萍	20~50亿	翊安投资尊享1号	2.35%	-2.13%	-5.43%	-5.43%	10.32%	14.88%	15.65%	0.94	0.95	
杭州金时资产	高德赋	0~5亿	金时远航1号	2.30%	0.71%	0.57%	0.57%	15.50%	34.97%	29.01%	1.17	1.20	
盛泉恒元	赵忠东,徐永	100亿以上	盛泉恒元多策略灵活配置7号	2.14%	-0.74%	7.59%	7.59%	6.92%	19.73%	21.79%	1.09	0.90	
复熙资产	王铮	50~100亿	复熙恒赢7号	2.08%	-1.70%	0.72%	0.72%	9.40%	18.48%	10.33%	1.70	1.78	
千象资产	陈斌	100亿以上	千象卓越3号中证500指数增强	2.08%	-2.90%	-0.33%	-0.33%	12.30%	17.95%	19.94%	0.87	0.90	
润洲投资	潘正寰	20~50亿	润洲正行一号	2.00%	1.62%	11.00%	11.00%	14.22%	21.92%	14.22%	1.23	1.54	
宁水资本	程平庚	20~50亿	宁水多策略	1.94%	0.75%	12.44%	12.44%	9.70%	18.26%	14.73%	1.17	1.23	
量信投资	任重,高嵩	0~5亿	量信量化厚德	1.68%	-1.94%	0.49%	0.49%	8.89%	1.01%	23.40%	-0.00	0.04	
伏犀资本	姜谷辰	0~5亿	伏犀奇点2号	1.51%	0.93%	-7.57%	-7.57%	15.54%	18.46%	37.15%	0.82	0.49	
黑翼资产	陈泽浩	100亿以上	黑翼策略精选1号	1.32%	-0.64%	8.85%	8.85%	4.16%	20.79%	8.43%	1.52	2.46	
同温层私募	王林海,段海磊,徐安	20~50亿	同温层灵活配置1号	1.31%	-0.69%	4.77%	4.77%	6.77%	10.32%	10.65%	0.94	0.96	
均成资产	司维	50~100亿	均成宏观对冲1号	1.14%	-1.84%	16.51%	16.51%	12.41%	20.17%	12.41%	1.16	1.62	
珺容资产	毛科技	20~50亿	珺容宏观对冲3号	1.01%	-0.54%	-2.28%	-2.28%	7.50%	9.00%	9.31%	0.91	0.96	
中金量化	高健	10~20亿	中金量化策略精选1号	1.01%	-0.27%	7.87%	7.87%	3.30%	4.05%	8.08%	0.39	0.50	
钧富投资	潘凌俏,胡睿	20~50亿	钧富如风6号	0.84%	-0.55%	22.84%	22.84%	3.10%	12.33%	3.10%	2.38	3.97	
洛书投资	谢冬	50~100亿	洛书裕和延庆	0.84%	-1.12%	-5.18%	-5.18%	15.53%	4.45%	29.83%	0.29	0.14	
海南世纪前沿私募	吴敌	100亿以上	世纪前沿量化多策略一号	0.73%	-1.52%	8.95%	8.95%	2.87%	4.49%	7.52%	0.45	0.59	

复熙资产	罗思远,吴林峰	50~100亿	复熙恒赢11号	0.58%	-0.01%	6.75%	6.75%	0.75%	11.23%	2.69%	3.92	4.18	
华富资产	苏锦军	0~5亿	华富稳健5号	0.51%	-2.90%	-0.35%	-0.35%	8.03%	6.08%	7.59%	0.60	0.80	
和熙资产	姜适中	0~5亿	浙江和熙适中混合1号	0.42%	-1.90%	92.16%	92.16%	15.31%	31.87%	26.90%	0.98	1.18	
融升基金	侯茂林	10~20亿	融升稳健1号	0.38%	0.32%	15.01%	15.01%	0.32%	15.72%	6.45%	1.94	2.43	
稳博投资	殷陶	100亿以上	稳博长期投资高波动系列1号	0.18%	-1.03%	55.74%	55.74%	4.35%	38.84%	6.00%	2.54	6.47	
上海道合私募	赵斌	5~10亿	道合东哥1号	0.11%	-0.90%	-11.48%	-11.48%	13.58%	11.94%	26.89%	0.84	0.44	
鲲鹏投资	刘亮	10~20亿	鲲鹏量化复合1号	0.00%	-0.33%	8.53%	8.53%	7.49%	21.64%	30.67%	0.93	0.70	
中安汇富	戴春平	20~50亿	中安汇富-莲花山宏观对冲3号2期	-0.11%	-1.91%	-9.60%	-9.60%	18.25%	27.33%	28.96%	0.96	0.94	
吴泉投资	李全兵	0~5亿	吴泉量化均衡一号	-0.15%	-0.18%	7.62%	7.62%	4.52%	9.70%	10.85%	0.64	0.89	
量客私募	程庆	20~50亿	量客中宇一号	-0.88%	-0.81%	-3.61%	-3.61%	6.99%	0.51%	17.39%	-0.03	0.02	
文谛资产	周时和	10~20亿	文谛量化多策略一号	-1.02%	1.29%	-14.89%	-14.89%	15.41%	11.45%	18.72%	0.76	0.61	

## 多资产-复合策略多维度对比:



## 七、套利策略:

数据截至: 2023-12-29

管理人简称	投资经理	管理规模	产品简称	区间表现					成立以来				业绩走势图 (成立以来)
				本周收益	上周收益	今年以来收益	近1年收益	近1年回撤	年化收益	动态回撤	夏普比率	卡玛比率	
华富资产	苏锦军	0~5亿	华富衍生品1号	0.53%	0.21%	7.21%	7.21%	3.63%	15.40%	9.57%	1.70	1.60	
霁泽投资	张宁丰	10~20亿	霁泽夏天量化套利2号	0.51%	-0.11%	4.16%	4.16%	1.30%	8.84%	3.03%	1.68	2.91	
盛泉恒元	陈霄	100亿以上	盛泉恒元量化1号	0.41%	0.29%	17.24%	17.24%	0.80%	13.02%	4.64%	2.15	2.80	
百奕投资	苏介山	0~5亿	百奕传家一号	0.38%	0.38%	4.45%	4.45%	1.61%	11.91%	6.34%	1.30	1.87	
展弘投资	陈方府	100亿以上	展弘稳健1号	0.31%	-0.09%	4.80%	4.80%	0.15%	12.76%	3.36%	2.73	3.79	
上海悬铃私募	钱亮	20~50亿	悬铃C号	0.11%	0.33%	5.53%	5.53%	3.60%	16.62%	5.36%	1.72	3.10	

殊馥投资	庄琦	10~20亿	殊馥馥源套利1号	0.03%	0.19%	3.96%	3.96%	1.26%	7.91%	2.07%	2.22	3.81	
峰云汇	郑东云,罗巍	0~5亿	峰云汇哥伦布	-0.02%	0.35%	1.46%	1.46%	1.12%	12.15%	4.54%	1.79	2.67	
前海博普资产	袁豪	50~100亿	博普量化对冲6号A	-0.03%	-0.07%	5.95%	5.95%	0.93%	7.31%	3.72%	1.57	1.96	
涵德投资	秦志宇,顾小军	50~100亿	涵德量化稳健主基金	-0.09%	0.16%	5.61%	5.61%	3.79%	10.95%	7.22%	1.23	1.51	
橡杉资产	王丽明	0~5亿	橡杉量化套利三号	-0.10%	0.20%	3.58%	3.58%	0.69%	7.69%	3.84%	1.46	2.00	

## 多资产-套利策略收益对比：

