

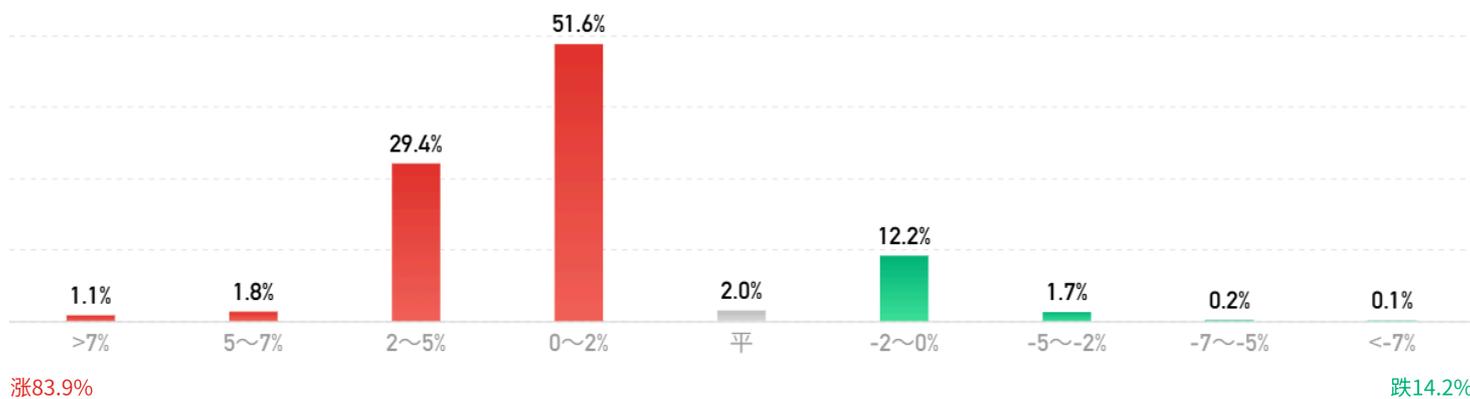
排排网全市场 重点私募基金跟踪周报

2025年05月14日

统计区间: 2025-04-30至 2025-05-09

上周涨跌总览: (2025-05-05-2025-05-09)

均涨幅 1.81% 均跌幅 -0.94%



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: 2025-05-09

| | 本周收益正负占比分布 | | 今年以来收益正负占比分布 | | 近一年收益正负占比分布 | |
|----------|------------|--------|--------------|--------|-------------|--------|
| 主观选股 | 84.49% | 15.51% | 67.10% | 32.90% | 82.01% | 17.99% |
| 沪深300指增 | 100.00% | 0.00% | 83.05% | 16.95% | 98.08% | 1.92% |
| 中证500指增 | 99.68% | 0.32% | 96.77% | 3.23% | 98.97% | 1.03% |
| 中证1000指增 | 99.03% | 0.97% | 99.51% | 0.49% | 97.45% | 2.55% |
| 量化选股 | 93.51% | 6.49% | 87.73% | 12.27% | 94.85% | 5.15% |
| 股票市场中性 | 93.63% | 6.37% | 92.59% | 7.41% | 85.22% | 14.78% |
| 转债交易 | 97.60% | 2.40% | 94.58% | 5.42% | 97.22% | 2.78% |
| 主观CTA | 71.25% | 28.75% | 73.96% | 26.05% | 88.81% | 11.19% |
| 量化CTA | 74.40% | 25.60% | 74.84% | 25.16% | 92.47% | 7.53% |
| 宏观策略 | 75.00% | 25.00% | 72.55% | 27.45% | 90.09% | 9.91% |
| 复合策略 | 89.23% | 10.77% | 81.43% | 18.57% | 91.46% | 8.54% |

数据来源: 基金管理人、基金托管人或估值核算机构, 更新到最新截止日期净值的所有代销产品简单数据统计。

1、各市场指数主要表现

数据截止: 2025-05-09

| | 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 | 3341.9989 | 1.92% | -0.29% | 5.94% | 10.08% |
| 深证成指 | 10126.8254 | 2.29% | -2.76% | 4.07% | -7.20% |
| 创业板指数 | 2011.7671 | 3.27% | -6.06% | 7.11% | -11.62% |
| 沪深300 | 3846.1566 | 2.00% | -2.26% | 4.91% | -1.88% |
| 中证500 | 5721.7225 | 1.60% | -0.07% | 3.37% | 0.56% |
| 中证全债 | 259.8598 | 0.14% | 0.75% | 6.60% | 17.60% |
| 南华商品指数 | 2387.1700 | -0.84% | -4.38% | -10.63% | 0.91% |

2、股票大盘指数

数据截至: 2025-05-09

| 股票指数 | 上证指数 | 深证成指 | 创业板指 | 沪深300 | 中证500 | 中证1000 | 中证2000 | 中证全指 |
|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 本周涨跌 | 1.92% | 2.29% | 3.27% | 2.00% | 1.60% | 2.22% | 3.58% | 2.28% |
| 2025年04月 | -1.70% | -5.75% | -7.40% | -3.00% | -3.86% | -4.44% | -2.84% | -3.32% |
| 2025年03月 | 0.45% | -1.01% | -3.07% | -0.07% | -0.04% | -0.70% | -1.12% | -0.42% |
| 2025年02月 | 2.16% | 4.48% | 5.16% | 1.91% | 4.84% | 7.26% | 9.47% | 4.64% |
| 2025年01月 | -3.02% | -2.48% | -3.63% | -2.99% | -2.38% | -1.87% | -1.08% | -2.48% |
| 2024年12月 | 0.76% | -1.86% | -3.71% | 0.47% | -2.16% | -3.74% | -4.98% | -1.97% |
| 2024年11月 | 1.42% | 0.19% | 2.75% | 0.66% | -0.84% | 1.18% | 3.96% | 1.08% |

3、股票风格指数

数据截至: 2025-05-09

| 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 | 2.70% | 1.95% | 1.37% | 1.53% | 1.89% | 1.34% |
| 2025年04月 | -1.45% | -4.68% | -3.25% | -5.83% | -3.89% | -4.43% |
| 2025年03月 | 1.82% | -0.37% | 2.33% | -0.71% | 1.39% | -0.71% |
| 2025年02月 | -0.84% | 3.80% | -1.49% | 2.45% | 1.62% | 5.19% |

4、商品指数

数据截至: 2025-05-09

| 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 | -0.84% | -0.98% | -0.92% | -0.78% | -0.58% | 0.40% | -2.44% | -0.47% |
| 2025年04月 | -5.01% | -3.97% | -6.48% | -7.97% | -1.07% | 2.68% | -4.33% | -3.80% |
| 2025年03月 | -0.73% | -0.51% | -2.13% | -3.12% | 0.59% | 8.23% | -4.20% | 2.52% |
| 2025年02月 | -0.29% | -0.03% | -1.61% | -2.68% | 2.23% | 3.17% | -2.42% | 1.53% |

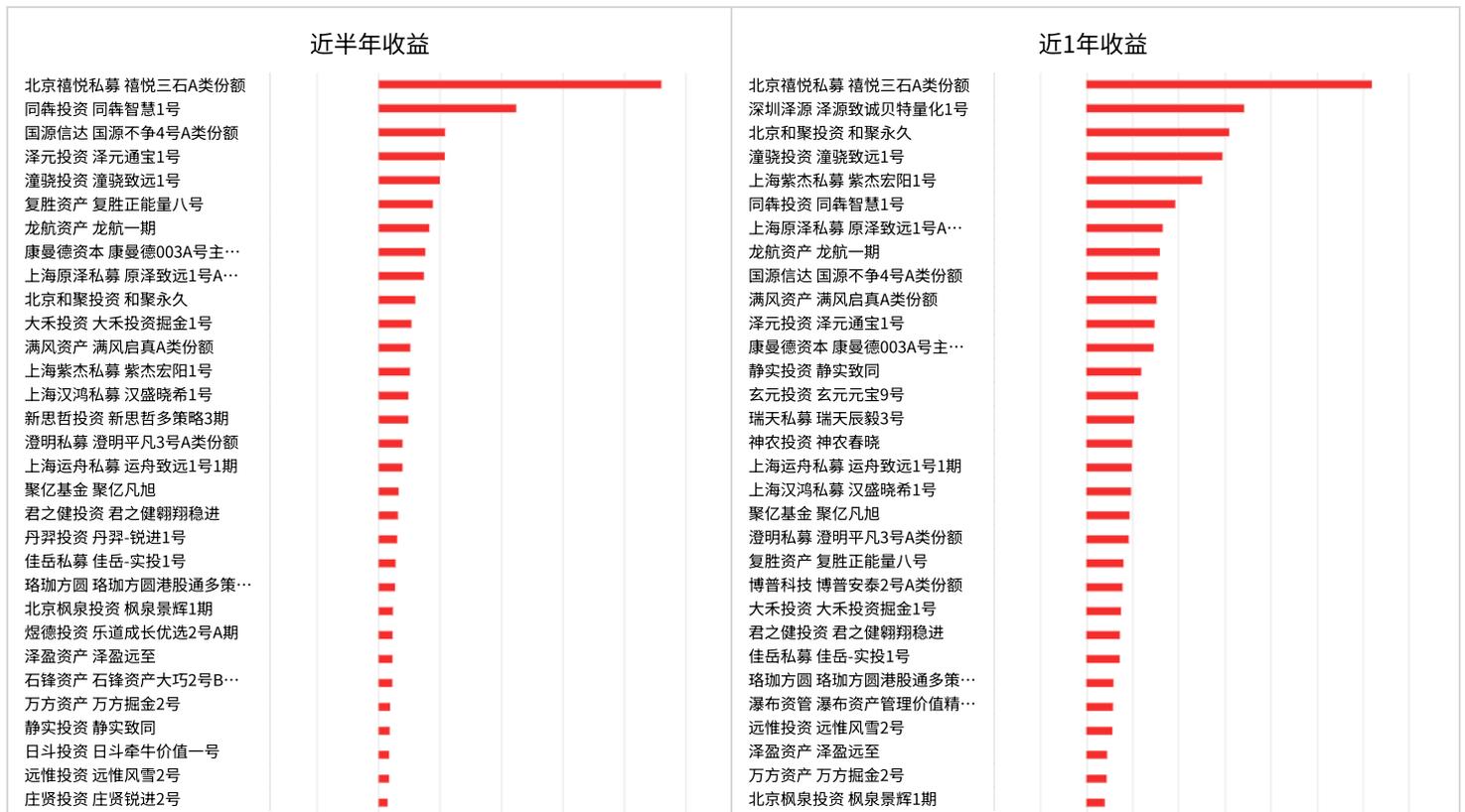
一、主观多头

数据截至: 2025-05-09

| | | 上证指数 | | | 深证成指 | | | 创业板指数 | | | | | |
|--------|------------|---------|---------------|---------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|--------|------|-----------------|
| | | 1.92% | -0.49% | -0.29% | 5.94% | 14.73% | | | | -- | | | |
| | | 2.29% | -0.17% | -2.76% | 4.07% | 18.53% | | | | -- | | | |
| | | 3.27% | 0.04% | -6.06% | 7.11% | 29.14% | | | | -- | | | |
| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |
| 北京禧悦私募 | 吴磊 | 5~10亿 | 禧悦三石A类份额 | 3762万 | 1.94% | 3.90% | 58.69% | 185.77% | 47.64% | 81.29% | 72.98% | 1.02 | |
| 深圳泽源 | 周立虎 | 10~20亿 | 泽源致诚贝特量化1号 | 10170万 | 6.84% | 1.56% | 41.47% | 102.67% | 33.60% | 71.89% | 33.60% | 1.27 | |
| 北京和聚投资 | 安永平 | 5~10亿 | 和聚永久 | 20034万 | -2.75% | -1.64% | 18.11% | 92.96% | 15.06% | 85.24% | 15.06% | 1.12 | |
| 潼骁投资 | 陈开伟 | 20~50亿 | 潼骁致远1号 | 3226万 | 0.39% | 0.49% | 42.68% | 88.55% | 17.97% | 16.23% | 41.99% | 0.60 | |
| 上海紫杰私募 | 曾书良 | 5~10亿 | 紫杰宏阳1号 | 32203万 | 5.41% | 2.79% | 18.95% | 75.33% | 20.09% | 44.89% | 33.66% | 1.41 | |
| 同犇投资 | 童驯 | 50~100亿 | 同犇智慧1号 | 7953万 | -1.53% | 7.35% | 55.32% | 57.90% | 15.92% | 14.08% | 67.33% | 0.58 | |
| 上海原泽私募 | 杨玉山 | 0~5亿 | 原泽致远1号A类份额 | 3361万 | 3.85% | -1.15% | 23.59% | 49.68% | 9.09% | 15.96% | 36.61% | 0.66 | |
| 龙航资产 | 蔡英明 | 10~20亿 | 龙航一期 | 9577万 | -2.81% | -10.40% | 24.21% | 47.85% | 26.81% | 44.48% | 44.81% | 0.99 | |
| 国源信达 | 李剑飞 | 20~50亿 | 国源不争4号A类份额 | 79692万 | 2.09% | -0.74% | 33.19% | 46.46% | 4.96% | 31.60% | 6.67% | 2.10 | |
| 满风资产 | 雷建辉 | 0~5亿 | 满风启真A类份额 | 22636万 | 0.17% | 0.06% | 19.72% | 45.68% | 9.31% | 24.59% | 17.01% | 1.07 | |
| 泽元投资 | 任文启 | 5~10亿 | 泽元通宝1号 | 34871万 | -0.02% | -0.13% | 43.02% | 44.37% | 17.67% | 34.59% | 18.75% | 1.23 | |
| 康曼德资本 | 丁榴 | 50~100亿 | 康曼德003A号主动管理型 | 6068万 | -0.80% | 0.83% | 21.45% | 43.79% | 16.38% | 18.72% | 27.05% | 0.84 | |
| 静实投资 | 郭亮 | 5~10亿 | 静实致同 | 10464万 | 0.82% | 0.46% | 6.60% | 35.72% | 1.45% | 5.76% | 13.41% | 0.46 | |
| 玄元投资 | 孔镇宁,张震宇 | 100亿以上 | 玄元元宝9号 | 5048万 | 0.73% | 2.02% | -7.73% | 33.71% | 16.13% | 9.38% | 23.46% | 0.47 | |
| 瑞天私募 | 杨绍基,林仲晞 | 0~5亿 | 瑞天辰毅3号 | 3672万 | 2.26% | -1.39% | 10.34% | 31.09% | 18.93% | 39.36% | 18.93% | 0.98 | |
| 神农投资 | 陈宇 | 20~50亿 | 神农春晓 | 61853万 | 0.72% | 0.47% | 9.36% | 29.87% | 26.07% | 17.73% | 34.39% | 0.63 | |
| 上海运舟私募 | 周应波 | 50~100亿 | 运舟致远1号1期 | 1320万 | 1.55% | 0.60% | 3.50% | 29.62% | 13.92% | 31.00% | 13.92% | 1.18 | |
| 上海汉鸿私募 | 杨正豪 | 5~10亿 | 汉盛晓希1号 | 9870万 | 1.89% | 0.38% | 10.32% | 29.11% | 10.85% | 20.56% | 12.05% | 1.23 | |
| 聚亿基金 | 张雷 | 0~5亿 | 聚亿凡旭 | 4547万 | 2.27% | 0.86% | 13.20% | 28.11% | 16.47% | 17.24% | 29.91% | 0.81 | |
| 澄明私募 | 石天卓 | 5~10亿 | 澄明平凡3号A类份额 | 17487万 | 0.56% | 0.13% | 13.87% | 27.53% | 9.62% | 12.98% | 26.86% | 0.49 | |
| 复胜资产 | 陆航 | 50~100亿 | 复胜正能量八号 | 21872万 | 0.33% | 3.18% | 27.13% | 24.11% | 13.95% | 35.89% | 34.46% | 1.18 | |
| 博普科技 | 袁豪,何瑞琳 | 50~100亿 | 博普安泰2号A类份额 | 27352万 | -2.27% | 4.13% | 1.11% | 23.52% | 21.90% | 29.42% | 27.57% | 1.04 | |
| 大禾投资 | 胡鲁滨 | 20~50亿 | 大禾投资掘金1号 | 59060万 | 3.00% | 0.80% | 12.94% | 22.55% | 8.43% | 38.16% | 58.86% | 0.99 | |
| 君之健投资 | 张勇 | 100亿以上 | 君之健翱翔稳进 | 164755万 | 2.28% | -0.32% | 5.74% | 21.83% | 8.85% | 14.41% | 16.62% | 1.03 | |
| 佳岳私募 | 薛松 | 20~50亿 | 佳岳-实投1号 | 37608万 | 2.34% | -1.61% | 1.35% | 21.72% | 17.90% | 21.20% | 26.67% | 0.78 | |
| 珞珈方圆 | 赖欣 | 5~10亿 | 珞珈方圆港股通多策略一期 | 5273万 | 1.40% | -0.20% | 4.57% | 17.62% | 21.15% | 12.50% | 31.86% | 0.53 | |
| 瀑布资管 | 孙左君 | 0~5亿 | 瀑布资产管理价值精选3期 | 1679万 | -0.84% | 1.82% | 2.28% | 17.31% | 6.76% | 8.97% | 29.25% | 0.49 | |
| 远惟投资 | 王烁杰 | 5~10亿 | 远惟风雪2号 | 29174万 | 1.87% | 1.53% | 8.16% | 16.93% | 15.19% | 23.73% | 30.52% | 1.10 | |
| 泽盈资产 | 李波,刘永建 | 10~20亿 | 泽盈远至 | 4689万 | 2.22% | 0.40% | 10.39% | 13.47% | 14.55% | 24.63% | 14.56% | 1.22 | |
| 万方资产 | 钱伟 | 20~50亿 | 万方掘金2号 | 15546万 | 2.54% | -0.43% | 1.41% | 13.18% | 11.02% | 11.97% | 59.39% | 0.50 | |
| 北京枫泉投资 | 陈政 | 10~20亿 | 枫泉景辉1期 | 79406万 | 0.19% | 1.40% | -3.61% | 11.96% | 13.50% | 20.13% | 22.30% | 1.01 | |
| 申九资产 | 朱晓亮 | 10~20亿 | 申九积极进取1号 | 11182万 | -1.19% | 1.76% | -4.18% | 11.63% | 17.13% | 9.50% | 44.24% | 0.42 | |
| 华炎私募 | 卢准煌,方翀,李裕铭 | 0~5亿 | 华炎华迪B期 | 1165万 | 0.50% | -0.08% | -0.62% | 9.80% | 3.71% | 10.19% | 7.34% | 1.11 | |

| | | | | | | | | | | | | | |
|---------|------------|---------|--------------|--------|--------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|------|--|
| 庄贤投资 | 王安 | 10~20亿 | 庄贤锐进2号 | 4256万 | 0.35% | 0.77% | 9.05% | 9.46% | 6.28% | 20.03% | 33.13% | 1.06 | |
| 日斗投资 | 邹文,王文 | 100亿以上 | 日斗犀牛价值一号 | 86286万 | 2.91% | -0.36% | 5.20% | 8.93% | 12.09% | 26.61% | 25.57% | 0.96 | |
| 中欧瑞博 | 吴伟志 | 100亿以上 | 中欧瑞博赤兔一期 | 25118万 | 0.68% | -0.90% | 4.88% | 8.62% | 8.65% | 13.58% | 22.24% | 0.84 | |
| 禾永投资 | 顾义河,马哲峰 | 10~20亿 | 禾永尊享12号 | 5144万 | 0.33% | 0.07% | 2.87% | 8.15% | 1.92% | 10.96% | 3.82% | 1.39 | |
| 丹羿投资 | 朱亮 | 20~50亿 | 丹羿-锐进1号 | 22046万 | 3.37% | -0.05% | 11.25% | 8.00% | 15.46% | 15.27% | 42.79% | 0.72 | |
| 资瑞兴投资 | 汪忠远 | 5~10亿 | 资瑞兴一号 | 12923万 | 2.14% | -0.03% | 6.87% | 7.90% | 12.37% | 16.08% | 18.30% | 0.89 | |
| 名禹资产 | 陈美凤 | 20~50亿 | 名禹沐风1期 | 23966万 | 1.00% | 0.63% | 7.69% | 6.75% | 10.23% | 12.30% | 21.63% | 0.76 | |
| 煜德投资 | 靳天珍 | 20~50亿 | 乐道成长优选2号A期 | 21101万 | 1.91% | 0.33% | 6.99% | 5.60% | 16.04% | 6.99% | 39.92% | 0.39 | |
| 文多资产 | 范虎城 | 10~20亿 | 文多稳健一期 | 49200万 | 1.65% | 0.36% | 3.41% | 5.40% | 21.64% | 17.14% | 25.45% | 0.87 | |
| 新思哲投资 | 韩广斌 | 50~100亿 | 新思哲多策略3期 | 77450万 | 1.29% | 2.65% | 16.05% | 5.24% | 21.22% | 13.47% | 54.60% | 0.59 | |
| 东恺投资 | 吴明义,李威 | 10~20亿 | 东恺新时代成长一号 | 2035万 | 1.45% | -1.60% | -12.58% | 3.85% | 20.42% | 13.82% | 30.86% | 0.60 | |
| 东方港湾 | 但斌 | 100亿以上 | 东方港湾马拉松17号 | 8416万 | 4.03% | -0.76% | -19.99% | 3.77% | 33.24% | 8.19% | 48.05% | 0.39 | |
| 上海曜川私募 | 曾正香 | 5~10亿 | 曜川楚正进取一号 | 7332万 | 0.74% | -0.35% | -3.52% | 3.18% | 9.42% | 18.39% | 29.57% | 0.89 | |
| 玄元投资 | 张震宇 | 100亿以上 | 玄元元丰21号 | 32426万 | 0.00% | 1.79% | -11.82% | 2.66% | 18.66% | 9.56% | 19.71% | 0.51 | |
| 石锋资产 | 郭锋 | 50~100亿 | 石锋资产大巧2号B类份额 | 7419万 | 0.76% | 2.13% | 7.24% | 2.25% | 15.97% | 9.99% | 60.21% | 0.46 | |
| 上海白犀私募 | 李海 | 10~20亿 | 辛巴达母基金 | 18145万 | 2.28% | 0.66% | 4.39% | 2.19% | 13.49% | 21.00% | 26.60% | 0.90 | |
| 涌贝资产 | 谭涛 | 0~5亿 | 涌贝阳光稳健 | 2445万 | 0.49% | 0.23% | 3.31% | 0.85% | 11.91% | 21.21% | 42.83% | 0.67 | |
| 沅沅投资 | 陆晓明 | 0~5亿 | 沅沅精选2号 | 2090万 | 1.40% | 2.15% | -4.61% | -0.41% | 13.04% | 9.22% | 46.77% | 0.37 | |
| 正圆投资 | 廖茂林 | 50~100亿 | 正圆壹号 | 46558万 | 6.09% | -2.00% | -9.50% | -2.20% | 33.82% | 41.15% | 76.21% | 0.81 | |
| 上海仙人掌私募 | 姚跃 | 10~20亿 | 仙人掌盈沅远航一号 | 5966万 | 0.58% | 0.61% | 4.43% | -3.94% | 18.00% | 29.93% | 41.30% | 0.83 | |
| 上海远策投资 | 张益驰,谢利 | 20~50亿 | 远策发现者 | 3216万 | 1.13% | 1.34% | -1.72% | -4.54% | 12.13% | 5.77% | 47.43% | 0.29 | |
| 千榕资产 | 张亨鑫 | 0~5亿 | 千榕高山榕A类份额 | 9940万 | 5.77% | -1.08% | -6.22% | -4.94% | 20.43% | 15.23% | 20.43% | 0.62 | |
| 泾溪投资 | 赵乾明 | 10~20亿 | 泾溪中国优质成长3号 | 1617万 | -0.70% | -0.23% | -4.71% | -5.87% | 7.81% | 17.05% | 21.19% | 0.76 | |
| 纽富斯投资 | 丁训刚,詹础,徐继强 | 10~20亿 | 纽富斯价值精选 | 1809万 | 0.54% | -0.08% | -2.20% | -7.39% | 9.78% | 11.50% | 20.05% | 0.97 | |
| 海南希瓦 | 梁宏 | 100亿以上 | 希瓦小牛1号 | 28312万 | 1.70% | 1.68% | 1.04% | -8.31% | 21.56% | 26.19% | 41.99% | 1.00 | |
| 百创资本 | 陈子仪 | 5~10亿 | 长牛分析全球一号 | 7156万 | -2.68% | -3.49% | -16.93% | -8.85% | 19.96% | 6.74% | 50.44% | 0.33 | |
| 远望角投资 | 曾实 | 20~50亿 | 远望角致远6号 | 6491万 | 1.82% | 0.07% | -5.92% | -11.43% | 14.62% | 7.99% | 16.84% | 0.48 | |

主观多头区间对比





二、量化多头：

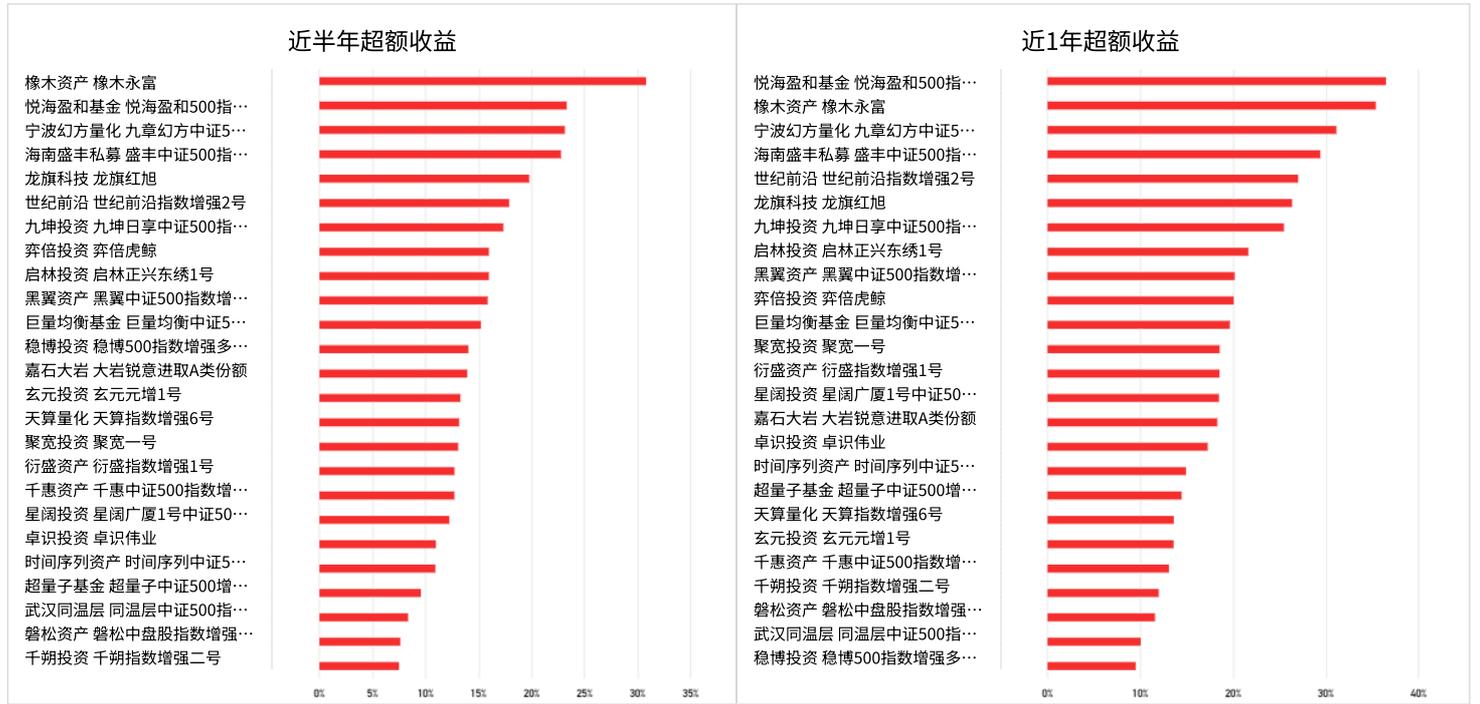
1、中证500指增-超额收益分析（几何）

数据截至：2025-05-09

| 中证500 | | | | | 1.60% | 0.08% | -0.07% | 3.37% | 19.59% | -- | | | | |
|--------|----------|---------|-----------------------|--------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|------|-----------------|
| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |
| 悦海盈和基金 | 王江宁 | 20~50亿 | 悦海盈和500指数增强1号 | 10975万 | 2.08% | 3.71% | -0.54% | 13.19% | 41.08% | 13.17% | 8.22% | 24.61% | 0.39 | |
| 橡木资产 | 楼建平 | 10~20亿 | 橡木永富 | 1637万 | 2.84% | 4.48% | 1.28% | 17.74% | 39.94% | 19.21% | 19.31% | 21.84% | 0.86 | |
| 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 | 25281万 | 1.71% | 3.34% | 0.92% | 11.97% | 35.55% | 12.35% | 20.45% | 34.55% | 0.93 | |
| 海南盛丰私募 | 林子洋 | 20~50亿 | 盛丰中证500指数增强1号 | 1531万 | 2.06% | 3.69% | 0.07% | 14.76% | 33.76% | 15.88% | 12.17% | 26.84% | 0.54 | |
| 世纪前沿 | 周志豪 | 100亿以上 | 世纪前沿指数增强2号 | 18778万 | 0.93% | 2.54% | -0.18% | 9.37% | 31.28% | 15.84% | 22.61% | 27.11% | 0.97 | |
| 龙旗科技 | 朱晓康 | 100亿以上 | 龙旗红旭 | 6904万 | 1.51% | 3.13% | 0.25% | 11.18% | 30.62% | 14.55% | 15.07% | 32.06% | 0.67 | |
| 九坤投资 | 姚齐聪 | 100亿以上 | 九坤日享中证500指数增强1号 | 14534万 | 1.12% | 2.74% | 0.47% | 9.64% | 29.71% | 14.29% | 18.28% | 28.91% | 0.82 | |
| 启林投资 | 王鸿勇 | 100亿以上 | 启林正兴东绣1号 | 6744万 | 1.13% | 2.74% | 0.82% | 9.18% | 25.75% | 14.93% | 16.02% | 35.47% | 0.75 | |
| 黑翼资产 | 邹倚天 | 100亿以上 | 黑翼中证500指数增强专享1号 | 4097万 | 0.53% | 2.13% | 0.34% | 8.45% | 24.23% | 16.63% | 16.92% | 28.46% | 0.81 | |
| 弈倍投资 | 余建国, 汤昕烨 | 10~20亿 | 弈倍虎鲸 | 3653万 | 1.08% | 2.69% | -0.08% | 7.54% | 24.13% | 16.17% | 13.50% | 32.05% | 0.62 | |
| 巨量均衡基金 | 程志田 | 0~5亿 | 巨量均衡中证500进取型指数增强枫露紫一号 | 2643万 | 2.27% | 3.91% | -0.25% | 7.98% | 23.69% | 16.22% | 9.14% | 20.20% | 0.46 | |
| 聚宽投资 | 高斯蒙 | 50~100亿 | 聚宽一号 | 9108万 | 0.94% | 2.55% | 0.09% | 8.37% | 22.56% | 15.15% | 22.24% | 26.27% | 0.94 | |
| 衍盛资产 | 章友 | 20~50亿 | 衍盛指数增强1号 | 13248万 | 1.11% | 2.72% | 0.34% | 8.44% | 22.53% | 14.38% | 13.72% | 33.69% | 0.60 | |
| 星阔投资 | 邓剑 | 10~20亿 | 星阔广厦1号中证500指数增强 | 3277万 | 0.76% | 2.37% | -0.44% | 6.65% | 22.47% | 16.61% | 11.66% | 31.67% | 0.53 | |
| 嘉石大岩 | 黄铂 | 20~50亿 | 大岩锐意进取A类份额 | 2859万 | 2.57% | 4.20% | 0.92% | 9.21% | 22.29% | 14.64% | 16.37% | 27.13% | 0.75 | |
| 卓识投资 | 张卓 | 100亿以上 | 卓识伟业 | 28510万 | 0.90% | 2.51% | 0.07% | 4.96% | 21.21% | 14.10% | 15.86% | 21.38% | 0.79 | |
| 时间序列资产 | 王英昊 | 10~20亿 | 时间序列中证500指数增强2号 | 2089万 | 0.61% | 2.22% | -0.02% | 4.91% | 18.80% | 14.38% | 7.03% | 28.15% | 0.35 | |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|-------|--------------|---------|--------------------|--------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------|--|
| 超量子基金 | 张晓泉 | 50~100亿 | 超量子中证500增强2号 | 15561万 | 0.31% | 1.91% | 0.69% | 6.14% | 18.31% | 20.09% | 7.59% | 27.33% | 0.37 | |
| 天算量化 | 何天鹰 | 50~100亿 | 天算指数增强6号 | 3606万 | 1.58% | 3.21% | 0.63% | 6.39% | 17.45% | 17.32% | 12.19% | 26.58% | 0.58 | |
| 玄元投资 | 孔镇宁, 张青, 张伟 | 100亿以上 | 玄元元增1号 | 17821万 | 1.07% | 2.69% | 0.19% | 6.86% | 17.42% | 17.20% | 16.00% | 26.91% | 0.76 | |
| 千惠资产 | 陈立奎 | 20~50亿 | 千惠中证500指数增强1号 | 4919万 | 1.02% | 2.63% | 0.20% | 5.99% | 16.89% | 16.26% | -0.24% | 29.02% | 0.00 | |
| 千朔投资 | 黄辉 | 20~50亿 | 千朔指数增强二号 | 2800万 | 0.65% | 2.25% | -0.20% | 4.30% | 15.76% | 17.20% | 14.01% | 30.63% | 0.65 | |
| 磐松资产 | 吴确 | 50~100亿 | 磐松中盘股指数增强2号 | 20349万 | 0.23% | 1.83% | 0.11% | 2.60% | 15.31% | 15.80% | 11.91% | 24.58% | 0.49 | |
| 武汉同温层 | 王林海, 段海磊, 李煜 | 20~50亿 | 同温层中证500指数增强1号 | 12650万 | 0.51% | 2.11% | 0.26% | 4.86% | 13.76% | 17.55% | 17.15% | 24.05% | 0.75 | |
| 稳博投资 | 殷陶 | 100亿以上 | 稳博500指数增强多策略1号A类份额 | 3536万 | 1.12% | 2.73% | 0.31% | 8.94% | 13.20% | 20.25% | 10.48% | 26.29% | 0.51 | |

中证500指数增强产品-超额收益（几何）对比：



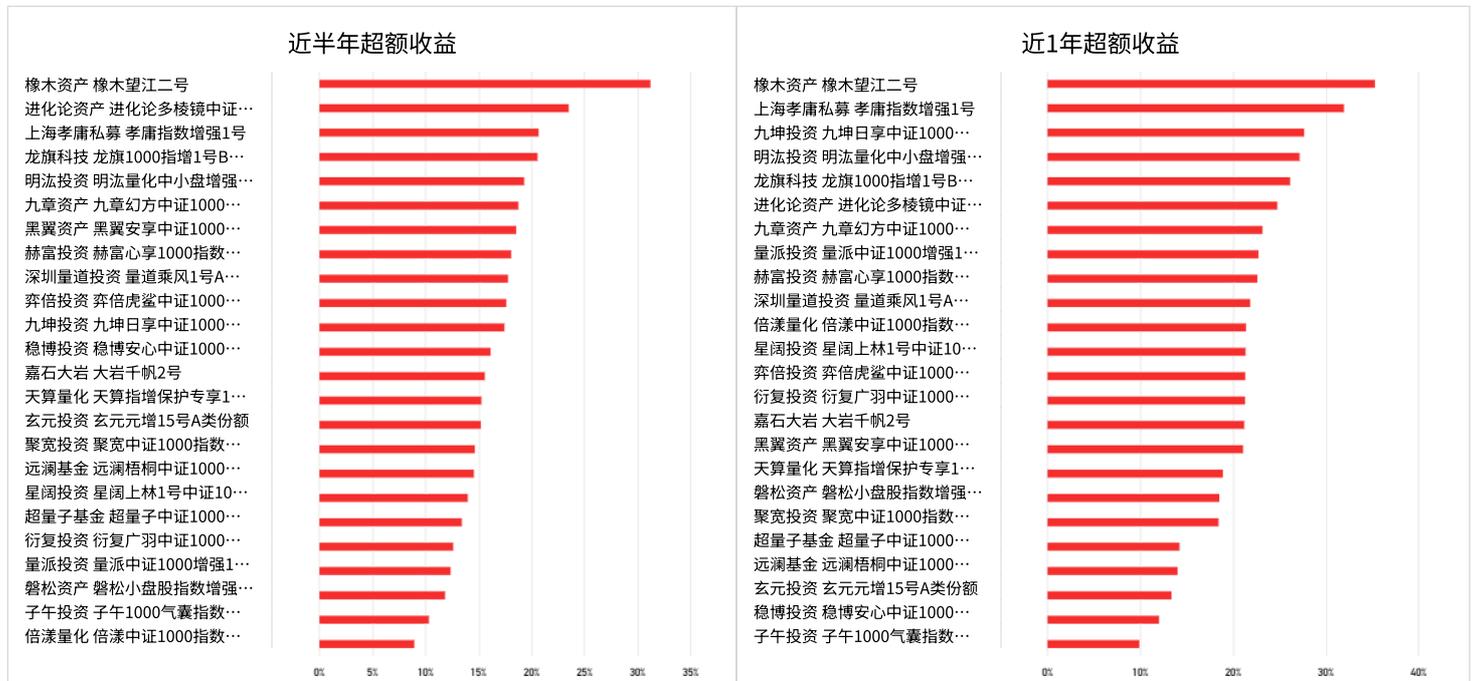
2、中证1000指增-超额收益分析（几何）

数据截至：2025-05-09

| 中证1000 | | 2.22% | 0.18% | 2.09% | 9.11% | 21.40% | -- | | | | | | | |
|--------|----------|--------|-------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|------|-----------------|
| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |
| 橡木资产 | 仲引辉 | 10~20亿 | 橡木望江二号 | 3301万 | 1.61% | 3.86% | 0.83% | 20.32% | 47.61% | 18.03% | 16.98% | 25.35% | 0.74 | |
| 上海孝庸私募 | 刘暘 | 20~50亿 | 孝庸指数增强1号 | 3478万 | 1.34% | 3.59% | 0.95% | 16.06% | 43.97% | 17.26% | 19.69% | 23.32% | 0.71 | |
| 九坤投资 | 姚齐聪 | 100亿以上 | 九坤日享中证1000指数增强1号 | 43388万 | 0.82% | 3.05% | 0.85% | 12.07% | 39.29% | 15.29% | 27.09% | 29.78% | 1.06 | |
| 明沅投资 | 裘慧明, 解环宇 | 100亿以上 | 明沅量化中小盘增强1号B类份额 | 34412万 | 1.03% | 3.27% | 1.44% | 16.06% | 38.76% | 18.53% | 30.70% | 26.14% | 1.15 | |
| 龙旗科技 | 朱晓康 | 100亿以上 | 龙旗1000指增1号B类份额 | 5622万 | 1.75% | 4.01% | 0.66% | 14.17% | 37.64% | 14.96% | 9.96% | 27.26% | 0.43 | |
| 进化论资产 | 王一平 | 100亿以上 | 进化论多棱镜中证1000指数增强 | 22254万 | 1.08% | 3.33% | 1.05% | 19.10% | 36.14% | 15.95% | 47.52% | 20.03% | 1.18 | |
| 九章资产 | 陈哲 | 100亿以上 | 九章幻方中证1000量化多策略1号 | 28255万 | 0.98% | 3.22% | 0.88% | 11.96% | 34.41% | 12.75% | 28.62% | 33.18% | 1.16 | |
| 量派投资 | 孙林 | 100亿以上 | 量派中证1000增强12号 | 43158万 | 0.81% | 3.04% | 0.47% | 8.96% | 33.91% | 16.26% | 17.39% | 26.76% | 0.69 | |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|--------|-------------|---------|--------------------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|------|--|
| 赫富投资 | 蔡觉逸 | 50~100亿 | 赫富心享1000指数增强1号 | 2522万 | 0.85% | 3.08% | 0.61% | 13.66% | 33.80% | 17.98% | 11.53% | 30.27% | 0.47 | |
| 深圳量道投资 | 李喆腾, 张凤羽 | 50~100亿 | 量道乘风1号A类份额 | 3182万 | 0.89% | 3.13% | 0.22% | 13.80% | 32.95% | 17.45% | 14.58% | 24.31% | 0.58 | |
| 倍漾量化 | 蔡其志 | 20~50亿 | 倍漾中证1000指数增强1期A类份额 | 64166万 | 0.84% | 3.08% | -0.18% | 8.85% | 32.47% | 18.08% | 20.01% | 25.49% | 0.74 | |
| 星阔投资 | 邓剑 | 10~20亿 | 星阔上林1号中证1000指数增强 | 2690万 | 0.62% | 2.85% | 0.22% | 9.84% | 32.41% | 17.67% | 13.25% | 30.72% | 0.53 | |
| 弈倍投资 | 汤昕烨 | 10~20亿 | 弈倍虎鲨中证1000指数增强 | 1747万 | 0.72% | 2.95% | 0.37% | 12.03% | 32.37% | 16.84% | 8.19% | 25.84% | 0.38 | |
| 衍复投资 | 高亢 | 100亿以上 | 衍复广羽中证1000量化多头1号2期 | 26937万 | 0.29% | 2.52% | 0.94% | 10.13% | 32.36% | 14.32% | 14.53% | 22.04% | 0.61 | |
| 嘉石大岩 | 黄铂 | 20~50亿 | 大岩千帆2号 | 5708万 | 1.17% | 3.42% | 1.10% | 11.52% | 32.25% | 15.24% | 14.22% | 21.40% | 0.67 | |
| 黑翼资产 | 邹倚天 | 100亿以上 | 黑翼安享中证1000指数增强6号 | 2051万 | 0.54% | 2.77% | 0.76% | 13.45% | 32.11% | 18.45% | 9.68% | 27.16% | 0.43 | |
| 天算量化 | 何天鹰 | 50~100亿 | 天算指增保护专享1号A类份额 | 1853万 | -0.23% | 1.98% | 0.93% | 11.18% | 29.74% | 10.91% | 18.81% | 10.91% | 1.32 | |
| 磐松资产 | 吴确 | 50~100亿 | 磐松小盘股指数增强2号 | 27714万 | 0.54% | 2.77% | 0.69% | 9.71% | 29.37% | 16.68% | 31.56% | 16.77% | 1.11 | |
| 聚宽投资 | 高斯蒙, 郭嵩 | 50~100亿 | 聚宽中证1000指数增强一号 | 7773万 | 0.92% | 3.15% | 0.58% | 12.40% | 29.23% | 16.47% | 2.72% | 29.27% | 0.16 | |
| 超量子基金 | 张晓泉 | 50~100亿 | 超量子中证1000增强1号 | 1102万 | 0.22% | 2.44% | 1.05% | 11.56% | 24.64% | 22.20% | 11.00% | 23.63% | 0.45 | |
| 远澜基金 | 董致远 | 20~50亿 | 远澜梧桐中证1000指数增强B类份额 | 3923万 | 0.81% | 3.05% | 0.27% | 10.33% | 24.42% | 16.57% | 10.38% | 24.66% | 0.47 | |
| 玄元投资 | 孔镇宁, 商震, 张伟 | 100亿以上 | 玄元元增15号A类份额 | 6968万 | 1.12% | 3.36% | 0.45% | 11.23% | 23.70% | 18.23% | 7.36% | 24.86% | 0.37 | |
| 稳博投资 | 殷陶 | 100亿以上 | 稳博安心中证1000指数增强系列6号 | 3433万 | 1.31% | 3.55% | 0.59% | 14.40% | 22.22% | 21.54% | 7.58% | 29.39% | 0.35 | |
| 子午投资 | 谢兰 | 20~50亿 | 子午1000气囊指数增强五号 | 7079万 | -0.37% | 1.84% | 0.57% | 9.21% | 19.92% | 13.85% | 28.18% | 13.85% | 1.13 | |

中证1000指数增强产品-超额收益（几何）对比：



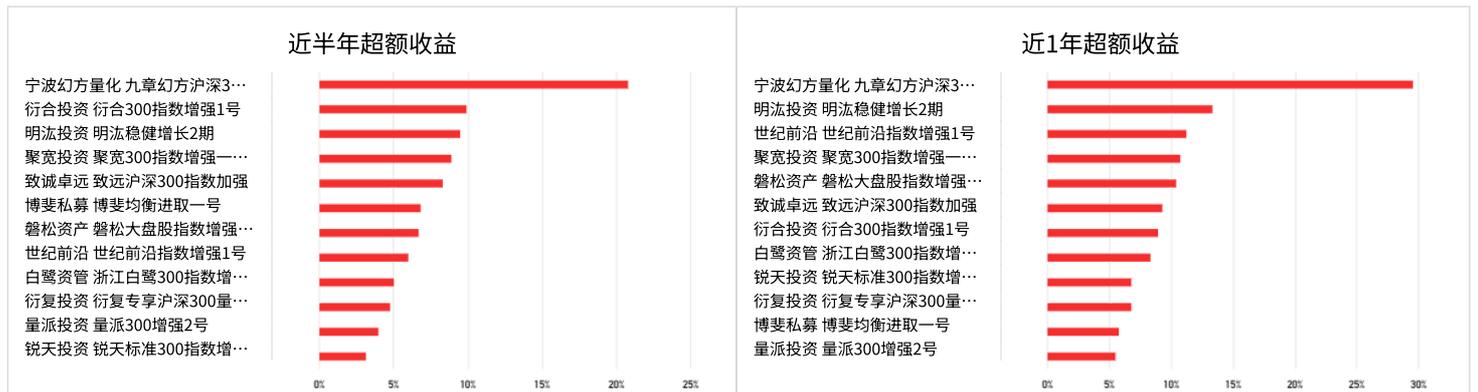
3、沪深300指增-超额收益分析（几何）

数据截至：2025-05-09

| 沪深300 | | | | 2.00% | -0.43% | -2.26% | 4.91% | 15.66% | -- | | | | | |
|-------|------|------|------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|-------|------|------|------|-----------------|
| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|--------|------------------|---------|------------------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|------|--|
| 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 | 15331万 | 1.14% | 3.17% | 1.05% | 12.43% | 35.89% | 12.06% | 20.11% | 33.86% | 0.92 | |
| 明沚投资 | 裘慧明, 解环宇, 张磊, 刘楠 | 100亿以上 | 明沚稳健增长2期 | 14859万 | 0.26% | 2.27% | -0.70% | 4.30% | 18.91% | 12.63% | 15.26% | 24.76% | 0.78 | |
| 世纪前沿 | 周志豪 | 100亿以上 | 世纪前沿指数增强1号 | 8171万 | 0.35% | 2.37% | -0.39% | 1.94% | 16.69% | 12.17% | 8.20% | 28.69% | 0.47 | |
| 聚宽投资 | 满奇 | 50~100亿 | 聚宽300指数增强一号C类份额 | 16203万 | 0.07% | 2.08% | -0.73% | 2.82% | 16.17% | 11.37% | 17.47% | 11.37% | 0.92 | |
| 磐松资产 | 吴确 | 50~100亿 | 磐松大盘股指数增强4号 | 5072万 | -0.15% | 1.85% | -0.26% | 2.07% | 15.72% | 11.98% | 16.30% | 11.98% | 0.69 | |
| 致诚卓远 | 史帆 | 100亿以上 | 致远沪深300指数加强 | 4693万 | -0.16% | 1.84% | -0.17% | 3.05% | 14.66% | 9.22% | 13.86% | 25.83% | 0.71 | |
| 衍合投资 | 汤亦多, 张磊 | 5~10亿 | 衍合300指数增强1号 | 1114万 | 0.56% | 2.58% | -0.34% | 4.60% | 14.28% | 13.01% | 0.47% | 25.91% | 0.01 | |
| 白鹭资管 | 张晨樱 | 20~50亿 | 浙江白鹭300指数增强二号 | 3931万 | 0.15% | 2.16% | -0.69% | 1.72% | 13.64% | 11.66% | 8.17% | 34.13% | 0.44 | |
| 锐天投资 | 徐晓波 | 100亿以上 | 锐天标准300指数增强1号 | 9063万 | 0.05% | 2.06% | -0.65% | -0.09% | 12.02% | 12.30% | 10.88% | 19.97% | 0.61 | |
| 衍复投资 | 高亢 | 100亿以上 | 衍复专享沪深300量化多头一号 | 13643万 | 0.10% | 2.11% | -0.28% | 0.59% | 12.02% | 10.46% | 2.97% | 17.38% | 0.16 | |
| 博斐私募 | 刘锋林 | 0~5亿 | 博斐均衡进取一号 | 1489万 | -1.12% | 0.86% | -0.17% | -0.78% | 10.96% | 7.14% | 5.47% | 12.17% | 0.46 | |
| 量派投资 | 孙林 | 100亿以上 | 量派300增强2号 | 49222万 | 0.29% | 2.30% | -0.35% | 0.74% | 10.68% | 12.68% | 3.78% | 25.04% | 0.20 | |

沪深300指数增强产品-超额收益（几何）对比：



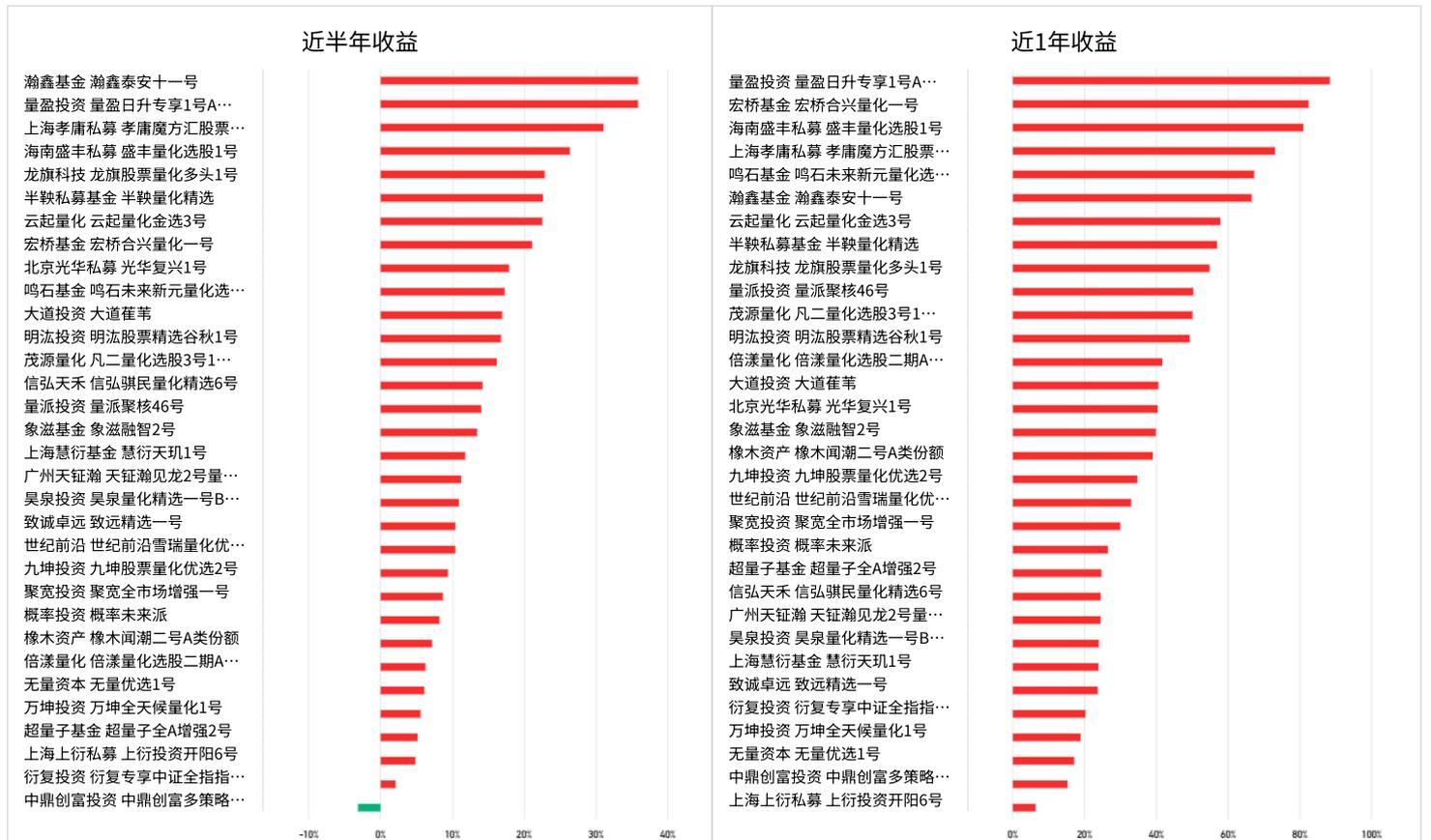
4、量化选股-收益回撤分析

数据截至：2025-05-09

| 中证全指 | | | | | 2.28% | -0.02% | 0.48% | 7.87% | 17.16% | -- | | | |
|--------|---------|--------|----------------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|------|-----------------|
| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |
| 量盈投资 | 丁鹏 | 5~10亿 | 量盈日升专享1号A类份额 | 6769万 | 5.69% | 1.33% | 33.47% | 88.37% | 18.41% | 25.03% | 34.01% | 0.84 | |
| 宏桥基金 | 宋世杰, 王洋 | 5~10亿 | 宏桥合兴量化一号 | 39916万 | 2.93% | -0.32% | 13.58% | 82.43% | 10.43% | 30.77% | 20.58% | 1.08 | |
| 海南盛丰私募 | 林子洋 | 20~50亿 | 盛丰量化选股1号 | 50278万 | 4.24% | 0.17% | 20.16% | 80.94% | 15.79% | 61.55% | 20.10% | 1.63 | |
| 上海孝庸私募 | 刘暘 | 20~50亿 | 孝庸魔方汇股票优选一号 | 27559万 | 4.53% | 1.88% | 27.26% | 73.06% | 14.71% | 57.17% | 22.49% | 1.49 | |
| 鸣石基金 | 王晓晗 | 100亿以上 | 鸣石未来新元量化选股1号C期 | 8846万 | 3.65% | 1.50% | 14.61% | 67.28% | 12.90% | 11.67% | 29.07% | 0.54 | |
| 瀚鑫基金 | 王泽原 | 0~5亿 | 瀚鑫泰安十一号 | 13093万 | 3.92% | 1.50% | 22.25% | 66.57% | 15.94% | 39.27% | 31.66% | 1.69 | |
| 云起量化 | 施恩 | 20~50亿 | 云起量化金选3号 | 7660万 | 3.95% | 1.86% | 20.86% | 57.86% | 12.52% | 17.02% | 33.65% | 0.72 | |
| 半鞅私募基金 | 王芹, 周东 | 10~20亿 | 半鞅量化精选 | 37090万 | 4.13% | 0.66% | 17.89% | 56.94% | 12.72% | 23.74% | 25.88% | 0.87 | |
| 龙旗科技 | 朱晓康 | 100亿以上 | 龙旗股票量化多头1号 | 15149万 | 3.98% | 0.82% | 20.85% | 54.82% | 11.95% | 12.47% | 31.48% | 0.51 | |
| 量派投资 | 孙林 | 100亿以上 | 量派聚核46号 | 14509万 | 3.79% | 0.78% | 13.35% | 50.33% | 14.36% | 26.03% | 24.68% | 0.88 | |

| | | | | | | | | | | | | | |
|--------|------------|---------|----------------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|------|--|
| 茂源量化 | 郭学文 | 100亿以上 | 凡二量化选股3期A类份额 | 14102万 | 3.45% | 0.82% | 15.23% | 50.12% | 13.32% | 16.60% | 25.22% | 0.68 | |
| 明沬投资 | 裘慧明,解环宇 | 100亿以上 | 明沬股票精选谷秋1号 | 11547万 | 3.93% | 1.11% | 17.24% | 49.32% | 16.26% | 11.20% | 31.52% | 0.47 | |
| 倍漾量化 | 蔡其志 | 20~50亿 | 倍漾量化选股二期A类份额 | 37840万 | 3.38% | 0.15% | 12.12% | 41.67% | 15.88% | 20.37% | 27.59% | 0.62 | |
| 大道投资 | 朱明强 | 20~50亿 | 大道萑萑 | 3233万 | 3.61% | 1.06% | 17.07% | 40.60% | 16.09% | 15.36% | 23.97% | 0.71 | |
| 北京光华私募 | 李彬,阿永嘎,李奇泽 | 0~5亿 | 光华复兴1号 | 1839万 | 4.34% | 2.21% | 20.33% | 40.38% | 17.41% | 20.87% | 24.75% | 0.85 | |
| 象滋基金 | 孟浩,牟国华 | 0~5亿 | 象滋融智2号 | 2107万 | 3.98% | 1.79% | 12.16% | 39.91% | 14.59% | 7.68% | 39.73% | 0.35 | |
| 橡木资产 | 于攀峰 | 10~20亿 | 橡木闻潮二号A类份额 | 13188万 | 4.89% | 0.28% | 7.92% | 39.02% | 15.56% | 15.19% | 17.58% | 0.76 | |
| 九坤投资 | 王琛 | 100亿以上 | 九坤股票量化优选2号 | 18275万 | 2.68% | 0.48% | 10.27% | 34.72% | 13.75% | 10.52% | 28.01% | 0.49 | |
| 世纪前沿 | 吴敌 | 100亿以上 | 世纪前沿雪瑞量化优选2号一期 | 2534万 | 2.75% | 0.00% | 11.09% | 33.00% | 15.76% | 16.96% | 22.17% | 0.69 | |
| 聚宽投资 | 高斯蒙 | 50~100亿 | 聚宽全市场增强一号 | 11856万 | 2.82% | 0.16% | 12.04% | 29.97% | 13.44% | 6.63% | 29.08% | 0.33 | |
| 概率投资 | 杨曦 | 5~10亿 | 概率未来派 | 15664万 | 2.02% | 0.33% | 11.74% | 26.53% | 4.92% | 26.93% | 5.20% | 2.47 | |
| 超量子基金 | 詹焯扬 | 50~100亿 | 超量子全A增强2号 | 2288万 | 2.52% | 0.58% | 7.52% | 24.73% | 16.79% | 7.21% | 27.03% | 0.36 | |
| 信弘天禾 | 章毅 | 100亿以上 | 信弘民量化精选6号 | 1038万 | 4.65% | 2.26% | 18.20% | 24.51% | 19.62% | 10.87% | 26.80% | 0.49 | |
| 广州天钰瀚 | 曹俊毅 | 0~5亿 | 天钰瀚见龙2号量化多头一期 | 3810万 | 2.67% | -0.10% | 8.89% | 24.49% | 7.70% | 16.00% | 21.61% | 0.83 | |
| 泉泉投资 | 游甘泉 | 0~5亿 | 泉泉量化精选一号B类份额 | 1363万 | 2.63% | 0.00% | 11.31% | 24.01% | 13.72% | 23.99% | 21.05% | 1.10 | |
| 上海慧衍基金 | 许红伟 | 5~10亿 | 慧衍天玑1号 | 2041万 | 3.34% | 1.05% | 9.69% | 23.89% | 9.65% | 16.26% | 18.02% | 0.98 | |
| 致诚卓远 | 史帆 | 100亿以上 | 致远精选一号 | 4599万 | 3.45% | 0.69% | 11.98% | 23.69% | 16.54% | 19.35% | 27.96% | 0.84 | |
| 衍复投资 | 高亢 | 100亿以上 | 衍复专享中证全指指数增强一号 | 7010万 | 2.35% | 0.29% | 4.97% | 20.28% | 11.61% | 22.79% | 11.61% | 0.93 | |
| 万坤投资 | 王云翔 | 5~10亿 | 万坤全天候量化1号 | 13993万 | 1.64% | -0.21% | 5.83% | 18.93% | 20.55% | 13.87% | 31.47% | 0.61 | |
| 无量资本 | 朱自珍 | 5~10亿 | 无量优选1号 | 1068万 | 3.60% | 0.38% | 8.77% | 17.15% | 15.28% | 5.97% | 27.60% | 0.32 | |
| 中鼎创富投资 | 蔡喜浩 | 0~5亿 | 中鼎创富多策略母基金1号2期 | 3026万 | 7.55% | -0.88% | 4.88% | 15.25% | 18.49% | 6.09% | 27.71% | 0.27 | |
| 上海上行私募 | 陈皓 | 5~10亿 | 上行投资开阳6号 | 2359万 | 0.83% | 0.28% | 6.45% | 6.39% | 21.54% | 18.44% | 23.09% | 0.70 | |

量化选股-多维度对比



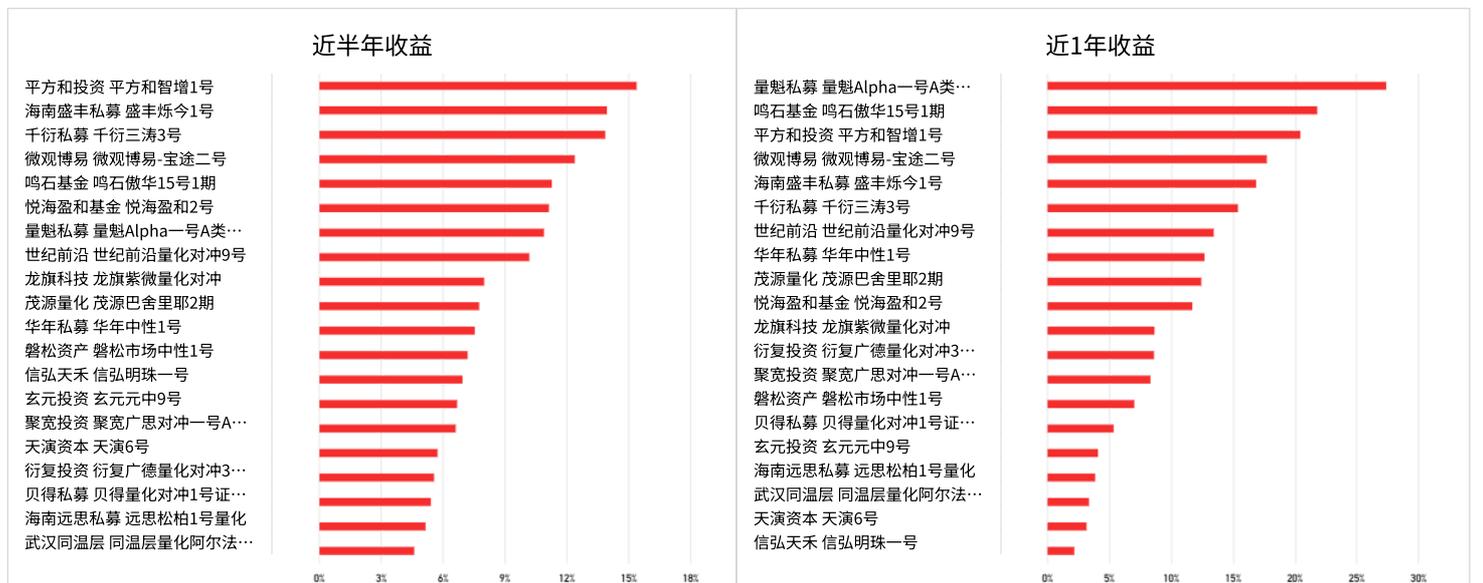
备注：超额收益计算方法，超额收益，又叫基金的相对收益，代表一定时间区间内，基金收益超出基准收益的部分。本报告采用超额收益(几何法)，具体计算方式如下： $超额收益(几何)=(基金收益+1)/(基准收益+1)-1$

三、量化对冲-市场中性策略：

数据截至：2025-05-09

| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |
| 量魁私募 | 梁涛 | 50~100亿 | 量魁Alpha一号A类份额 | 51673万 | 0.45% | -0.13% | 6.16% | 27.38% | 1.92% | 11.47% | 6.87% | 1.33 | |
| 鸣石基金 | 杨堃 | 100亿以上 | 鸣石傲华15号1期 | 8291万 | 0.75% | 0.50% | 7.70% | 21.80% | 4.29% | 10.77% | 9.52% | 1.21 | |
| 平方和投资 | 吕杰勇 | 50~100亿 | 平方和智增1号 | 16634万 | 0.45% | 0.60% | 8.96% | 20.44% | 5.13% | 13.65% | 10.43% | 1.59 | |
| 微观博易 | 吴晓青 | 50~100亿 | 微观博易-宝途二号 | 1539万 | 1.09% | -0.22% | 7.51% | 17.73% | 5.22% | 13.86% | 5.22% | 2.25 | |
| 海南盛丰私募 | 林子洋 | 20~50亿 | 盛丰烁今1号 | 10363万 | 0.71% | -0.16% | 4.85% | 16.87% | 2.81% | 12.91% | 4.17% | 1.83 | |
| 千衍私募 | 马双杰 | 50~100亿 | 千衍三涛3号 | 16842万 | 0.94% | 0.26% | 9.21% | 15.40% | 5.41% | 11.23% | 6.38% | 1.36 | |
| 世纪前沿 | 吴敌 | 100亿以上 | 世纪前沿量化对冲9号 | 53733万 | 0.13% | -0.14% | 6.01% | 13.44% | 5.71% | 12.22% | 8.86% | 1.23 | |
| 华年私募 | 薛钰新 | 5~10亿 | 华年中性1号 | 3477万 | 0.45% | 0.54% | 5.52% | 12.70% | 3.45% | 未满一年 | 3.45% | 2.00 | |
| 茂源量化 | 郭学文 | 100亿以上 | 茂源巴舍里耶2期 | 19084万 | 0.43% | -0.16% | 3.85% | 12.44% | 3.42% | 9.24% | 9.37% | 1.22 | |
| 悦海盈和基金 | 王江宁 | 20~50亿 | 悦海盈和2号 | 6467万 | 0.95% | -0.14% | 6.09% | 11.71% | 4.41% | 8.08% | 7.65% | 1.10 | |
| 龙旗科技 | 朱晓康 | 100亿以上 | 龙旗紫微量对冲 | 14847万 | 0.85% | -0.02% | 3.49% | 8.65% | 4.76% | 9.44% | 12.52% | 1.03 | |
| 衍复投资 | 高亢 | 100亿以上 | 衍复广德量化对冲3号A类份额 | 6207万 | 0.41% | 0.13% | 2.94% | 8.61% | 4.60% | 6.30% | 7.71% | 0.90 | |
| 聚宽投资 | 高斯蒙 | 50~100亿 | 聚宽广思对冲一号A类份额 | 1956万 | 0.54% | -0.02% | 5.67% | 8.33% | 3.72% | 3.33% | 7.32% | 0.33 | |
| 磐松资产 | 吴确 | 50~100亿 | 磐松市场中性1号 | 11995万 | 0.40% | -0.11% | 4.56% | 7.02% | 4.60% | 10.97% | 4.90% | 1.83 | |
| 贝得私募 | 夏钦 | 0~5亿 | 贝得量化对冲1号证券投资 | 5285万 | 1.52% | 0.45% | 2.07% | 5.35% | 6.12% | 6.76% | 6.12% | 0.88 | |
| 玄元投资 | 孔镇宁,商震,张伟 | 100亿以上 | 玄元元中9号 | 17050万 | 0.47% | -0.16% | 3.30% | 4.09% | 6.14% | 4.28% | 6.14% | 0.63 | |
| 海南远思私募 | 陈晓伟 | 0~5亿 | 远思松柏1号量化 | 2618万 | 0.30% | -0.28% | 2.07% | 3.86% | 7.57% | 7.46% | 8.02% | 1.13 | |
| 武汉同温层 | 段海磊,徐安,叶仕帅 | 20~50亿 | 同温层量化阿尔法3号证券投资 | 7757万 | 0.22% | 0.13% | 3.29% | 3.36% | 2.80% | 6.91% | 3.49% | 1.68 | |
| 天演资本 | 谢晓阳 | 100亿以上 | 天演6号 | 3131万 | 0.03% | -0.04% | 3.08% | 3.16% | 6.38% | 9.89% | 12.90% | 1.31 | |
| 信弘天禾 | 张华,章毅 | 100亿以上 | 信弘明珠一号 | 4006万 | 0.88% | 0.17% | 5.13% | 2.17% | 6.65% | 7.95% | 12.46% | 0.77 | |

量化对冲-市场中性多维度对比

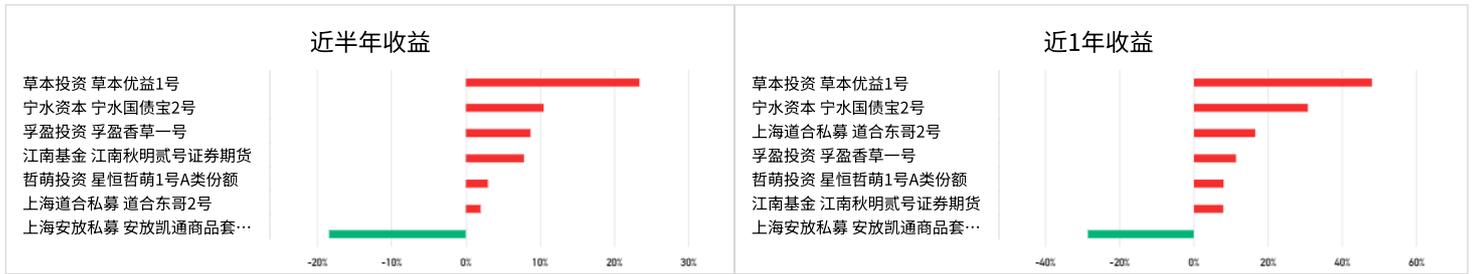


四、主观CTA：

数据截至：2025-05-09

| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |
| 草本投资 | 黄莹,曹登雷,王冲 | 5~10亿 | 草本优益1号 | 27867万 | -0.94% | 0.79% | 25.05% | 47.97% | 5.22% | 34.14% | 12.33% | 1.25 | |
| 宁水资本 | 邓飞 | 50~100亿 | 宁水国债宝2号 | 37083万 | -0.37% | 1.14% | 3.17% | 30.67% | 5.83% | 33.52% | 16.59% | 1.56 | |
| 上海道合私募 | 徐勇军 | 0~5亿 | 道合东哥2号 | 4491万 | 0.68% | 0.34% | 7.10% | 16.53% | 8.58% | 16.95% | 20.43% | 1.15 | |
| 孚盈投资 | 蒋鲜林 | 0~5亿 | 孚盈香草一号 | 6564万 | -0.08% | -0.42% | 8.36% | 11.35% | 2.62% | 20.65% | 21.22% | 1.21 | |
| 哲萌投资 | 朱哲平 | 10~20亿 | 星恒哲萌1号A类份额 | 34488万 | 0.24% | 0.05% | 2.25% | 7.99% | 2.01% | 14.03% | 14.06% | 1.07 | |
| 江南基金 | 刘强 | 0~5亿 | 江南秋明贰号证券期货 | 3833万 | 0.71% | 0.30% | 7.54% | 7.89% | 3.76% | 未滿一年 | 3.76% | 1.26 | |
| 上海安放私募 | 薛颖 | 20~50亿 | 安放凯通商品套利1号 | 1548万 | 0.28% | 0.47% | -11.43% | -28.55% | 32.20% | 55.50% | 32.20% | 1.09 | |

主观CTA策略多维度对比：



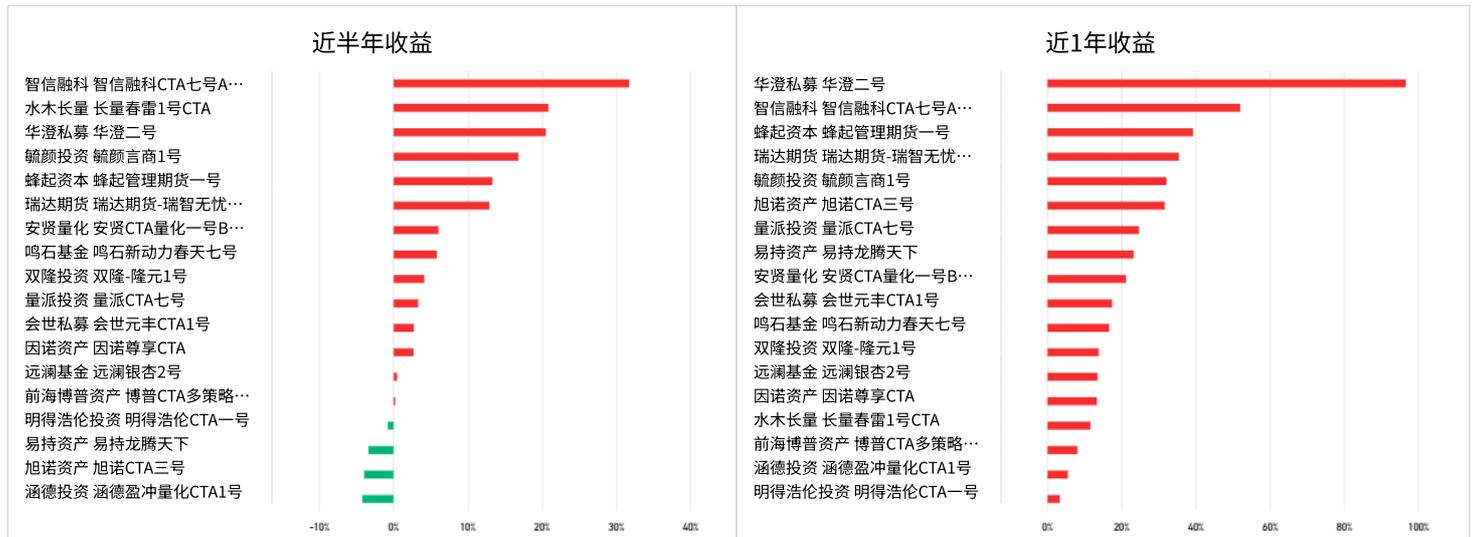
五、量化CTA：

数据截至：2025-05-09

| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |
| 华澄私募 | 颜宇阶 | 0~5亿 | 华澄二号 | 4300万 | 0.63% | 1.03% | 20.29% | 96.56% | 5.54% | 32.48% | 37.15% | 1.06 | |
| 智信融科 | 武征鹏 | 0~5亿 | 智信融科CTA七号A类份额 | 3902万 | 1.15% | 0.52% | 26.40% | 51.96% | 3.68% | 未滿一年 | 10.57% | 1.22 | |
| 蜂起资本 | 潘筠宝,王琴,洪泽宇 | 5~10亿 | 蜂起管理期货一号 | 11829万 | 2.39% | 0.35% | -1.62% | 39.26% | 6.91% | 26.52% | 22.43% | 0.95 | |
| 瑞达期货 | 黄青青 | -- | 瑞达期货-瑞智无忧共赢10号 | 3561万 | 1.57% | 0.86% | 9.56% | 35.44% | 5.48% | 17.16% | 17.08% | 1.21 | |
| 毓颜投资 | 陈家祥 | 0~5亿 | 毓颜言商1号 | 1321万 | 2.76% | 2.27% | 13.72% | 32.10% | 6.25% | 17.03% | 17.16% | 0.94 | |
| 旭诺资产 | 罗晨 | 20~50亿 | 旭诺CTA三号 | 40238万 | 0.34% | 0.40% | -6.32% | 31.59% | 11.61% | 23.41% | 18.17% | 0.91 | |
| 量派投资 | 孙林 | 100亿以上 | 量派CTA七号 | 56917万 | 0.60% | 0.38% | 0.75% | 24.68% | 3.17% | 22.65% | 3.17% | 2.27 | |
| 易持资产 | 谢海权 | 5~10亿 | 易持龙腾天下 | 10618万 | 0.76% | 0.16% | -1.74% | 23.27% | 9.41% | 23.04% | 32.90% | 0.73 | |
| 安贤量化 | 郑搏萧 | 20~50亿 | 安贤CTA量化一号B类份额 | 16799万 | -0.31% | -0.39% | 0.67% | 21.18% | 2.13% | 16.37% | 6.10% | 1.80 | |
| 会世私募 | 张议夫,姜胜 | 20~50亿 | 会世元丰CTA1号 | 18544万 | 1.11% | 0.66% | 1.99% | 17.42% | 2.73% | 11.11% | 17.56% | 1.07 | |
| 鸣石基金 | 袁宇 | 100亿以上 | 鸣石新动力春天七号 | 44198万 | 0.33% | -0.08% | 3.32% | 16.63% | 1.34% | 9.27% | 17.24% | 1.07 | |
| 双隆投资 | 李隽,陈挺 | 10~20亿 | 双隆-隆元1号 | 7183万 | 0.77% | -0.58% | 2.72% | 13.82% | 3.58% | 14.05% | 8.20% | 1.06 | |
| 远澜基金 | 王凯 | 20~50亿 | 远澜银杏2号 | 2713万 | 0.47% | 1.04% | 1.99% | 13.50% | 11.38% | 12.23% | 13.26% | 0.80 | |
| 因诺资产 | 徐书楠,刘恒 | 100亿以上 | 因诺尊享CTA | 8324万 | 0.11% | 0.43% | 1.93% | 13.32% | 6.45% | 12.95% | 6.45% | 0.88 | |
| 水木长量 | 杨英华 | 0~5亿 | 长量春雷1号CTA | 2524万 | -0.35% | -0.44% | 24.45% | 11.58% | 15.94% | 16.20% | 22.68% | 0.74 | |
| 前海博普资产 | 袁豪 | 50~100亿 | 博普CTA多策略2号1期 | 2427万 | 0.37% | 0.22% | -3.50% | 8.11% | 7.74% | 3.32% | 32.29% | 0.18 | |
| 涵德投资 | 秦志宇,顾小军 | 50~100亿 | 涵德盈冲量化CTA1号 | 10971万 | -0.22% | -0.61% | -2.60% | 5.52% | 4.30% | 18.94% | 9.72% | 1.27 | |

| | | | | | | | | | | | | | |
|--------|-----|------|-----------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|--------|------|--|
| 明得浩伦投资 | 孔令坤 | 0~5亿 | 明得浩伦CTA一号 | 1373万 | 1.38% | 0.67% | -1.66% | 3.36% | 5.39% | 8.97% | 18.37% | 0.60 | |
|--------|-----|------|-----------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|--------|------|--|

量化CTA策略多维度对比:



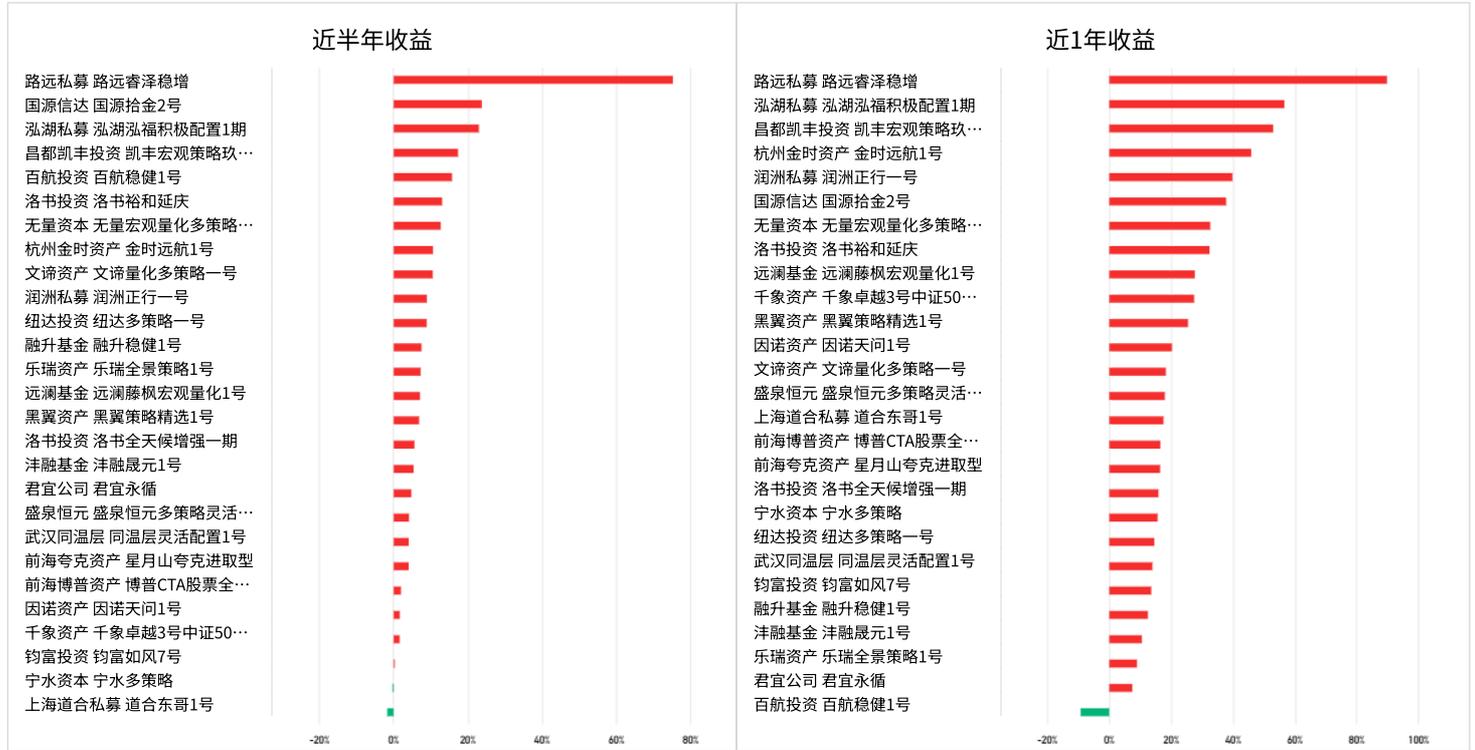
六、复合/宏观策略:

数据截至: 2025-05-09

| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 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 | |
| 路远私募 | 路文韬 | 5~10亿 | 路远睿泽稳增 | 33516万 | 2.39% | 1.46% | 74.83% | 89.74% | 25.11% | 36.29% | 33.57% | 1.02 | |
| 泓湖私募 | 梁文涛,汤诗语 | 100亿以上 | 泓湖泓福积极配置1期 | 87999万 | -0.06% | 1.62% | 14.70% | 56.60% | 11.36% | 未滿一年 | 11.36% | 1.45 | |
| 昌都凯丰投资 | 吴星 | 50~100亿 | 凯丰宏观策略玖昇1号证券投资 | 9656万 | 2.14% | 0.44% | 11.57% | 52.97% | 8.48% | 4.94% | 43.33% | 0.25 | |
| 杭州金时资产 | 高德赋 | 0~5亿 | 金时远航1号 | 2562万 | 4.83% | 0.55% | 13.74% | 45.90% | 8.99% | 29.44% | 35.12% | 1.02 | |
| 润洲私募 | 潘正寰 | 50~100亿 | 润洲正行一号 | 45431万 | 1.38% | -0.42% | 17.65% | 39.83% | 7.82% | 24.84% | 14.22% | 1.43 | |
| 国源信达 | 史江辉 | 20~50亿 | 国源拾金2号 | 21017万 | 1.19% | 0.14% | 19.57% | 37.77% | 5.97% | 20.07% | 18.06% | 0.95 | |
| 无量资本 | 李德安 | 5~10亿 | 无量宏观量化多策略1号 | 4949万 | 1.77% | 0.01% | 12.40% | 32.64% | 4.34% | 17.43% | 13.56% | 1.10 | |
| 洛书投资 | 谢冬 | 50~100亿 | 洛书裕和延庆 | 7770万 | 2.86% | -0.01% | 10.07% | 32.40% | 9.15% | 9.17% | 34.44% | 0.56 | |
| 远澜基金 | 陈鹏 | 20~50亿 | 远澜藤枫宏观量化1号 | 29488万 | 0.30% | 0.09% | 7.58% | 27.67% | 2.38% | 20.33% | 4.68% | 1.79 | |
| 千象资产 | 陈斌 | 100亿以上 | 千象卓越3号中证500指数增强 | 10284万 | 2.84% | -0.32% | 6.05% | 27.44% | 16.72% | 16.89% | 35.85% | 0.74 | |
| 黑翼资产 | 陈泽浩,邹倚天 | 100亿以上 | 黑翼策略精选1号 | 5376万 | 1.90% | 0.23% | 7.28% | 25.45% | 5.32% | 20.87% | 11.05% | 1.47 | |
| 因诺资产 | 徐书楠 | 100亿以上 | 因诺天问1号 | 19249万 | 1.36% | 0.48% | 2.31% | 20.28% | 10.25% | 15.77% | 11.23% | 0.93 | |
| 文谛资产 | 周时和 | 5~10亿 | 文谛量化多策略一号 | 5944万 | 0.04% | 0.04% | 3.66% | 18.29% | 7.49% | 11.45% | 24.86% | 0.77 | |
| 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 | 49550万 | 2.24% | 0.26% | 6.30% | 17.95% | 11.53% | 18.68% | 21.79% | 0.99 | |
| 上海道合私募 | 赵斌 | 0~5亿 | 道合东哥1号 | 1638万 | 0.49% | 0.78% | 1.27% | 17.52% | 8.98% | 12.12% | 28.98% | 0.88 | |
| 前海博普资产 | 袁豪 | 50~100亿 | 博普CTA股票全市场一号 | 19994万 | 1.62% | 0.33% | -0.82% | 16.50% | 12.10% | 5.69% | 37.16% | 0.30 | |
| 前海夸克资产 | 王升治 | 0~5亿 | 星月山夸克进取型 | 9044万 | 0.88% | 0.20% | 4.15% | 16.43% | 11.41% | 22.76% | 24.59% | 0.92 | |
| 洛书投资 | 罗迪 | 50~100亿 | 洛书全天候增强一期 | 6626万 | 0.09% | 0.33% | 2.10% | 15.88% | 4.09% | 19.50% | 4.09% | 2.27 | |
| 宁水资本 | 程平庚 | 50~100亿 | 宁水多策略 | 36875万 | -0.55% | -0.60% | 0.06% | 15.61% | 2.71% | 18.40% | 14.73% | 1.24 | |
| 纽达投资 | 邬雄辉 | 50~100亿 | 纽达多策略一号 | 5454万 | 1.53% | 0.30% | 4.56% | 14.55% | 10.79% | 6.44% | 20.45% | 0.41 | |
| 武汉同温层 | 王林海,段海磊,徐安 | 20~50亿 | 同温层灵活配置1号 | 4210万 | 1.71% | 0.24% | 6.09% | 13.93% | 7.82% | 11.32% | 11.48% | 0.90 | |

| | | | | | | | | | | | | | |
|------|--------|--------|----------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------|--|
| 钧富投资 | 潘凌霄,胡蓉 | 20~50亿 | 钧富如风7号 | 22442万 | 1.17% | -0.47% | 0.20% | 13.57% | 7.61% | 10.26% | 7.61% | 1.34 | |
| 融升基金 | 侯茂林 | 10~20亿 | 融升稳健1号 | 47635万 | 0.90% | 0.36% | 5.03% | 12.47% | 2.01% | 15.11% | 6.45% | 1.99 | |
| 沅融基金 | 吴荻,乐嵘 | 0~5亿 | 沅融晟元1号 | 1851万 | 0.76% | 0.05% | 1.72% | 10.52% | 5.56% | 14.73% | 5.56% | 2.13 | |
| 乐瑞资产 | 韩迪 | 100亿以上 | 乐瑞全景策略1号 | 1517万 | 0.30% | 0.17% | 7.65% | 8.94% | 2.88% | 15.59% | 3.35% | 1.52 | |
| 君宜公司 | 兰坤 | 20~50亿 | 君宜永循 | 12460万 | 0.59% | -0.34% | 3.07% | 7.45% | 7.08% | 19.38% | 8.06% | 1.46 | |
| 百航投资 | 李焕逸 | 0~5亿 | 百航稳健1号 | 14185万 | 0.25% | -3.35% | 6.71% | -9.26% | 33.62% | 26.33% | 34.75% | 0.94 | |

多资产-复合策略多维度对比:



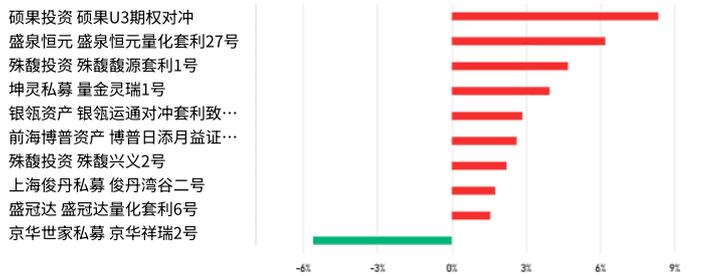
七、套利策略:

数据截至: 2025-05-09

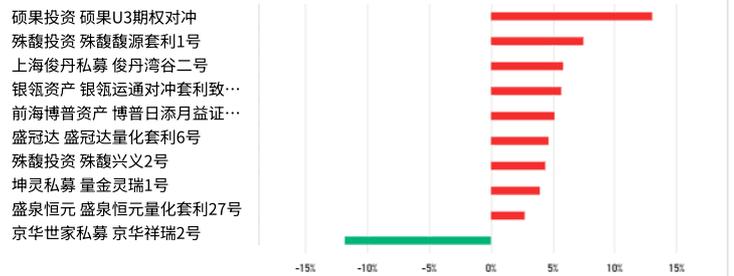
| 管理人简称 | 投资经理 | 管理规模 | 产品简称 | 产品规模 | 区间表现 | | | | | 成立以来 | | | 业绩走势图 (成立以来) |
|--------|---------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|------|-----------------|
| | | | | | 本周收益 | 上周收益 | 今年以来收益 | 近1年收益 | 近1年回撤 | 年化收益 | 动态回撤 | 夏普比率 | |
| 硕果投资 | 李靖坤 | 0~5亿 | 硕果U3期权对冲 | 2059万 | 0.15% | 0.31% | 1.64% | 13.02% | 10.66% | 11.47% | 10.66% | 1.07 | |
| 殊馥投资 | 庄琦 | 5~10亿 | 殊馥馥源套利1号 | 1939万 | 0.19% | 0.28% | 3.03% | 7.46% | 1.70% | 7.30% | 5.02% | 1.76 | |
| 上海俊丹私募 | 徐英捷,蔡薇拉 | 5~10亿 | 俊丹湾谷二号 | 12382万 | 0.00% | 0.10% | 0.90% | 5.82% | 0.19% | 7.62% | 0.70% | 2.44 | |
| 银瓴资产 | 莫帆 | 0~5亿 | 银瓴运通对冲套利致远3号 | 1304万 | 0.63% | 0.06% | -0.45% | 5.67% | 5.67% | 12.37% | 10.48% | 1.33 | |
| 前海博普资产 | 袁豪 | 50~100亿 | 博普日添月益证券投资A类份额 | 46714万 | -0.04% | -0.01% | 1.39% | 5.13% | 2.82% | 5.84% | 2.82% | 1.95 | |
| 盛冠达 | 黄灿 | 20~50亿 | 盛冠达量化套利6号 | 6843万 | 0.21% | 0.00% | 1.98% | 4.65% | 1.05% | 7.68% | 1.05% | 1.32 | |
| 殊馥投资 | 黄贤克 | 5~10亿 | 殊馥兴义2号 | 3415万 | -0.06% | 0.15% | 1.74% | 4.38% | 0.64% | 8.27% | 2.25% | 1.97 | |
| 坤灵私募 | 李玮 | 20~50亿 | 量金灵瑞1号 | 1492万 | -0.18% | -0.48% | 1.75% | 3.94% | 3.76% | 未滿一年 | 3.76% | 0.60 | |
| 盛泉恒元 | 徐永,刘振乾 | 100亿以上 | 盛泉恒元量化套利27号 | 6512万 | 0.73% | -0.31% | 5.42% | 2.72% | 5.40% | 6.36% | 6.05% | 1.00 | |
| 京华世家私募 | 王锦章 | 10~20亿 | 京华祥瑞2号 | 9786万 | 0.48% | -0.17% | -8.27% | -11.82% | 12.25% | 10.37% | 44.03% | 0.46 | |

多资产-套利策略收益对比:

近半年收益



近1年收益



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），基础数据来源于基金管理人/基金托管人/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、基金管理人及其委托的估值核算机构发布的经复核信息及数据为准。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。