

一、 市场表现回顾

1、 股票市场表现回顾

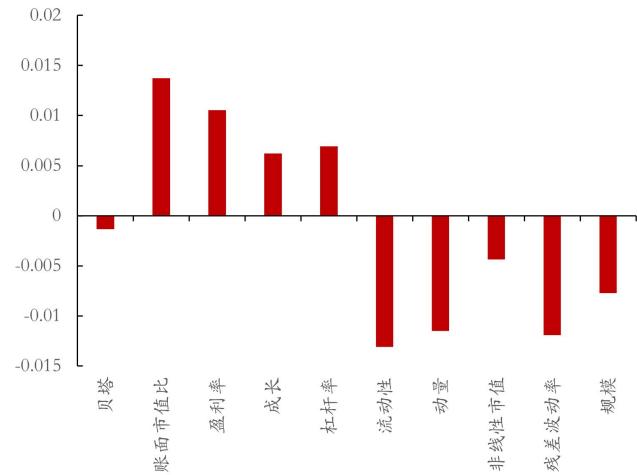
上周股票市场，各大主要指数小幅收涨，沪深 300 周度收益为 0.86%，较之于中小盘的 1.67%和 1.09%的涨幅较小。上周各大类风格因子涨跌参半，其中账面市值比、盈利率和成长因子录得显著正收益，剩余因子中流动性因子和动量因子的跌幅较大。上周沪深两市日均成交额 9616 亿元，较前一周下降 4.85%。波动率方面，主流宽基指数截面波动率分化，沪深 300 上周截面波动率分别下降 62BP，中证 500、中证 1000 指数上周截面波动率分别提升 67、101BP。

图表 1：股票市场表现

主要指数	周度涨跌	今年以来涨跌
沪深 300	0.86%	5.35%
中证 500	1.67%	-0.64%
中证 1000	1.09%	-6.04%
上证综指	0.92%	3.61%
深圳成指	1.16%	-3.06%
创业板指	1.22%	-0.84%

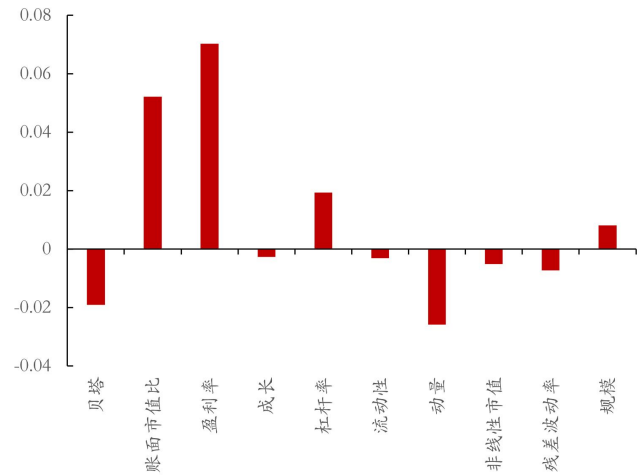
资料来源：Wind，数据截至 2024.04.03

图表 2：全市场股票风格因子收益（上周）



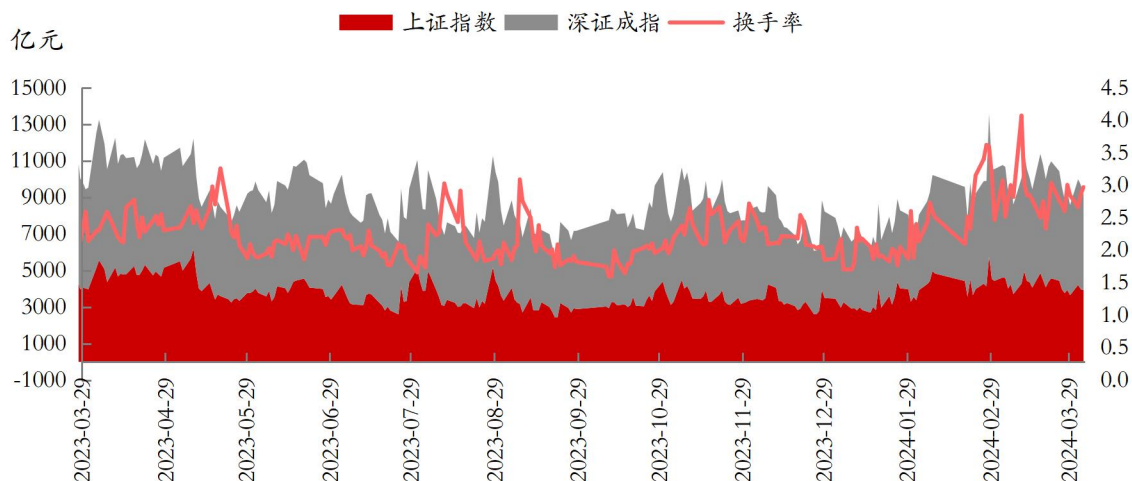
资料来源：Ricequant，数据截至 2024.04.03

图表 3：全市场股票风格因子收益（今年以来）



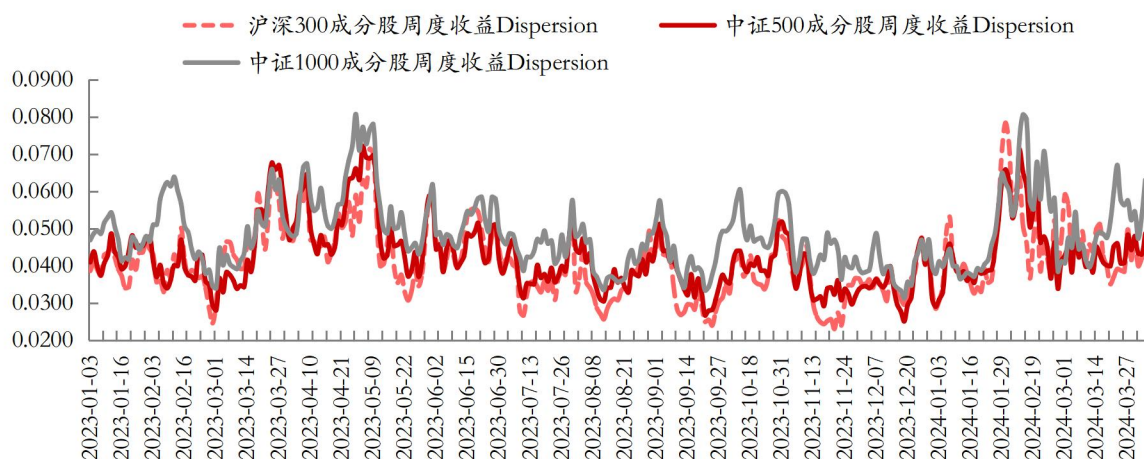
资料来源：Ricequant，数据截至 2024.04.03

图表 4：市场交投活跃度



资料来源：Wind，数据截至 2024.04.03

图表 5：主流宽基指数截面波动率



资料来源：Wind，数据截至 2024.04.03

2、商品市场表现回顾

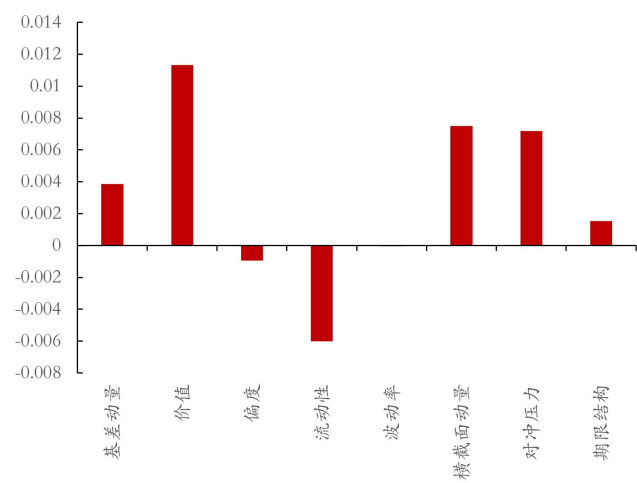
上周商品市场小幅收涨，南华综合指数-2.89%，分板块来看，农产品板块、能化板块、贵金属板块、有色金属板块和黑色板块上周收益分别为-0.36%、-1.65%、-6.39%、-3.48%和-3.31%。风格因子方面，上周因子多数收账，横截面动量因子、价值因子和偏度因子的涨幅较显著，其余因子中流动性因子等等跌幅显著，重点关注拐点引起的行情趋势。

图表 6：商品市场表现

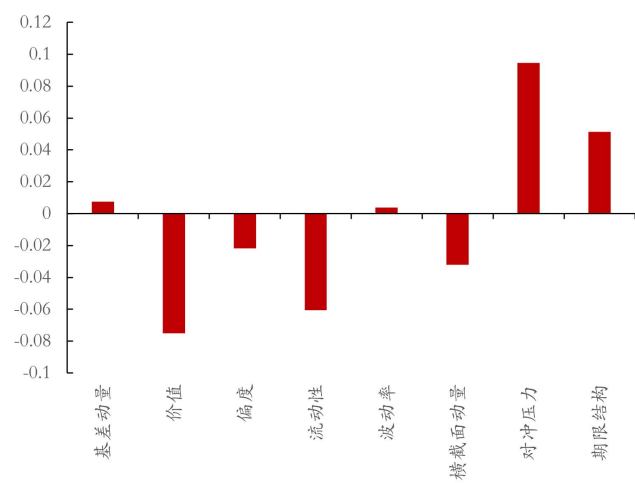
主要指数	周度涨跌	今年以来涨跌
南华综合指数	1.47%	0.82%
南华农产品指数	1.08%	3.64%
南华能化指数	1.04%	1.26%
南华贵金属指数	3.13%	11.92%
南华有色指数	1.52%	4.21%
南华黑色指数	0.28%	-17.95%

资料来源：Wind，数据截至 2024.04.03

图表 7：商品市场风格因子收益（上周）



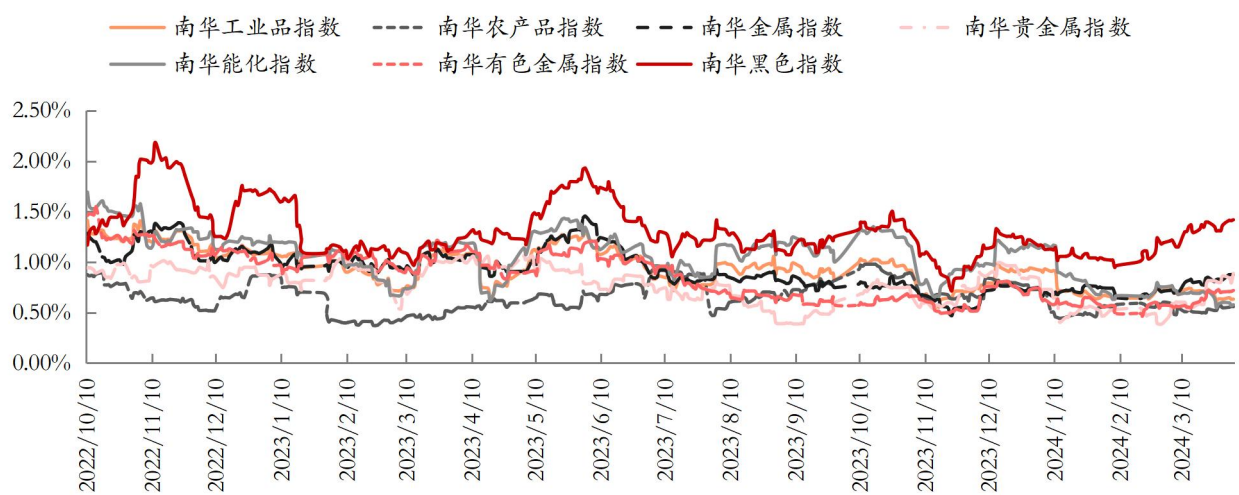
图表 8：商品市场风格因子收益（今年以来）



资料来源：Ricequant，数据截至 2024.04.03

资料来源：Ricequant，数据截至 2024.04.03

图表 9：商品指数波动率



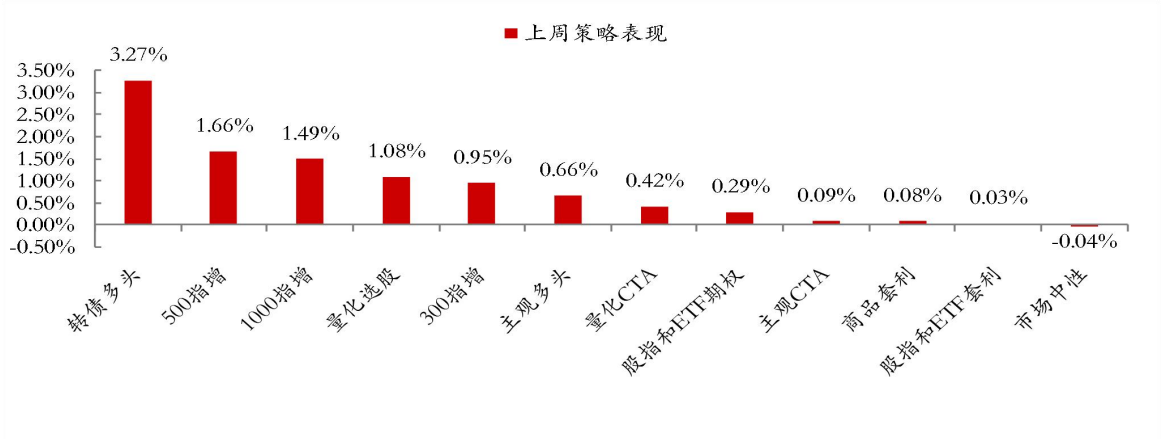
资料来源：Wind，数据截至 2024.04.03

二、 私募策略表现回顾

1、私募策略指数表现

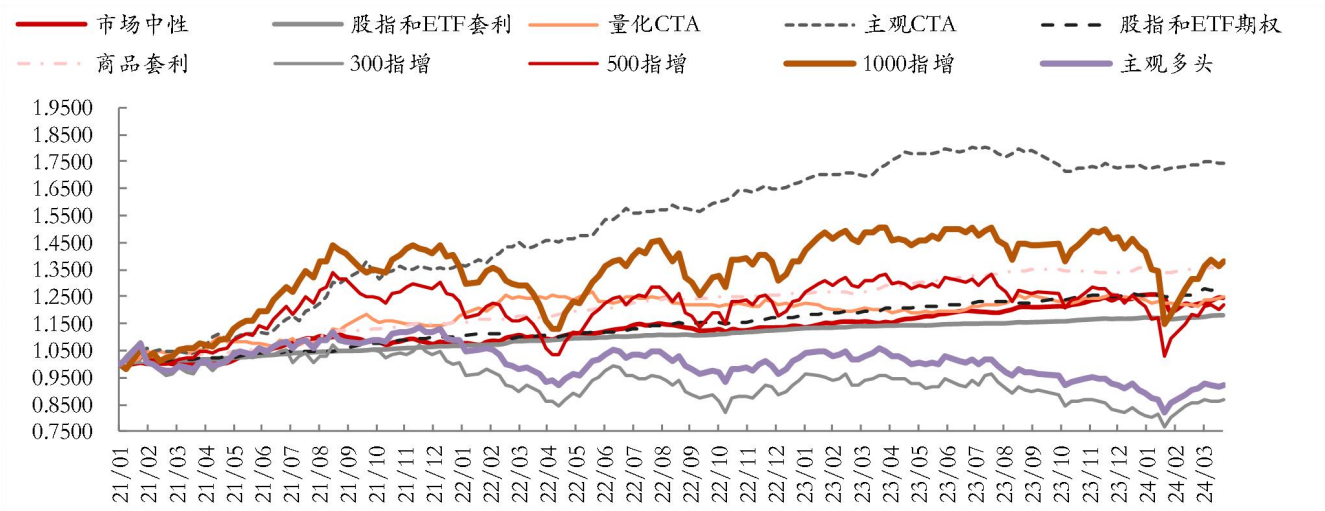
上周私募策略指数多数上涨，股票量化和转债多头策略领涨，其中 1000 指增和 500 指增涨超 1.4%，单周超额分别为 0.39%、-0.01%；量化 CTA 略强于主观 CTA，市场中性策略表现垫底，周度跌超 0.04%。

图表 10：私募策略指数周涨跌



数据截至 2024.04.03

图表 11：近三年私募策略指数表现



数据截至 2024.04.03

2、重点跟踪产品表现

图表 12：500 指增产品表现

私募业绩周度跟踪 20240327-20240403									
股票指数增强：500指增									
公司/经理	细分策略	成立日期	近一周	近一月	2024年	2023年	2022年	最大回撤	夏普
金戈量锐	500增强	2016-05-04	1.25%	3.97%	-4.63%	-1.22%	-10.34%	-30.65%	0.59
金锔资产	500增强	2020-07-09	1.21%	3.94%	-4.48%	3.31%	-10.04%	-26.16%	0.51
喜岳投资	500增强	2017-10-18	1.08%	4.56%	-0.44%	4.10%	-12.48%	-26.54%	0.58
幻方量化	500增强	2017-01-19	1.07%	3.28%	-7.70%	3.19%	-4.00%	-34.55%	0.87
稳博投资	500增强	2020-09-01	0.80%	6.05%	-3.53%	5.58%	-8.37%	-24.88%	0.59
灵均投资	500增强	2019-05-06	0.77%	2.78%	-9.03%	0.22%	-2.92%	-31.50%	0.90
千衍私募	500增强	2021-09-29	0.77%	6.31%	1.38%	15.59%	-6.13%	-19.52%	0.35
乾象私募	500增强	2021-03-08	0.69%	5.00%	1.98%	9.94%	1.19%	-18.79%	0.88
九坤投资	500增强	2017-06-21	0.46%	4.05%	-8.49%	12.67%	-9.22%	-28.74%	0.52
启林投资	500增强	2019-03-22	0.38%	3.74%	-13.07%	3.81%	-11.76%	-32.71%	0.60
诚奇资产	500增强	2020-09-04	0.36%	3.73%	-0.14%	1.78%	-7.34%	-22.93%	0.74
同温层	500增强	2020-06-03	0.33%	1.61%	5.05%	2.40%	-11.47%	-23.80%	0.96
衍复投资	500增强	2019-12-26	0.31%	3.72%	2.99%	11.30%	-1.60%	-18.13%	0.82
顽岩资产	500增强	2021-08-16	-0.07%	2.24%	-6.82%	6.13%	3.39%	-23.01%	0.53
子午投资	500增强	2021-08-09	-0.20%	3.22%	11.11%	5.18%	-1.27%	-21.57%	0.41
宽德投资	500增强	2019-11-07	-0.31%	2.74%	2.08%	15.80%	-2.23%	-21.70%	1.25
世纪前沿	500增强	2019-06-04	-0.40%	3.12%	-3.64%	7.68%	-8.33%	-28.97%	1.15
明法投资	500增强	2017-08-30	-0.44%	3.71%	-5.15%	6.57%	-5.42%	-24.29%	0.90
锐天投资	500增强	2018-12-27	-0.52%	3.08%	-3.02%	9.09%	-6.63%	-21.65%	0.69
信弘天禾	500增强	2020-10-29	-0.75%	0.20%	-5.52%	5.54%	-4.69%	-21.61%	0.46
简单平均			0.34%	3.55%	-2.55%	6.43%	-5.98%	-	-
中证500			-0.19%	-0.08%	-1.01%	-7.42%	-20.31%	-	-

管理人	上周超额收益	本月超额收益	上月超额收益	近半年超额收益	近一年超额收益	近三年超额收益	今年以来超额收益	去年超额收益
5%分位	-0.64%	-0.64%	-12.08%	-5.16%	-1.23%	12.61%	-9.04%	4.07%
25%分位	-0.35%	-0.35%	-8.14%	-1.06%	5.03%	26.80%	-4.15%	8.83%
中位数	-0.01%	-0.01%	-4.82%	1.71%	9.36%	36.66%	-2.09%	12.37%
75%分位	0.32%	0.32%	-2.05%	4.59%	12.82%	47.59%	1.13%	17.12%
95%分位	0.71%	0.71%	1.53%	11.33%	22.44%	69.47%	5.99%	23.86%

图表 13：1000 指增产品表现

私募业绩周度跟踪 20240327-20240403									
股票指数增强：1000指增									
公司/经理	细分策略	成立日期	近一周	近一月	2024年	2023年	2022年	最大回撤	夏普
幻方量化	1000增强	2018-10-09	1.01%	4.29%	-11.28%	8.81%	0.42%	-33.18%	1.40
磐松私募	1000增强	2023-01-09	0.92%	4.99%	3.99%	/	/	-23.82%	0.46
鸣熙资产	1000增强	2023-04-03	0.67%	6.76%	0.19%	/	/	-31.40%	0.07
稳博投资	1000增强	2020-04-28	0.50%	6.53%	-8.24%	16.79%	9.17%	-25.60%	1.09
金锔资产	1000增强	2018-11-12	0.36%	5.06%	-9.43%	8.94%	-5.13%	-29.19%	1.04
千衍私募	1000增强	2022-11-10	0.19%	7.72%	-0.94%	21.97%	/	-23.44%	0.86
半鞅私募	1000增强	2022-07-06	-0.48%	4.43%	-3.69%	5.89%	/	-25.51%	0.12
托特私募	1000增强	2022-04-07	-0.58%	4.16%	-5.80%	12.91%	/	-26.92%	1.02
信弘天禾	1000增强	2022-08-08	-0.63%	5.48%	-3.22%	13.85%	/	-22.64%	0.43
衍复投资	1000增强	2019-12-25	-0.82%	3.54%	-3.48%	14.36%	-3.70%	-21.81%	0.84
九坤投资	1000增强	2018-04-25	-1.01%	5.20%	-14.96%	16.94%	10.49%	-29.78%	0.69
量派投资	1000增强	2021-04-13	-1.11%	3.21%	-2.61%	7.81%	-10.41%	-26.76%	0.69
宽德投资	1000增强	2021-12-23	-1.17%	3.58%	-3.36%	15.41%	3.42%	-25.97%	0.41
蒙玺投资	1000增强	2021-10-12	-1.19%	3.21%	-0.47%	4.40%	-2.58%	-21.98%	0.17
衍合投资	1000增强	2021-12-31	-1.21%	3.35%	-0.22%	17.51%	0.60%	-23.17%	0.47
卓识基金	1000增强	2021-07-29	-1.24%	2.86%	-13.52%	11.86%	-6.92%	-27.28%	0.18
明法投资	1000增强	2019-04-04	-1.42%	3.71%	-3.98%	10.51%	-1.01%	-26.14%	1.37
希格斯	1000增强	2021-08-25	-1.51%	2.87%	-2.19%	4.94%	-7.15%	-28.17%	0.11
金戈量锐	1000增强	2021-11-04	-1.58%	3.30%	-6.77%	7.59%	-8.06%	-28.08%	0.53
盖亚青柯	1000增强	2023-02-17	-1.70%	1.74%	-2.05%	/	/	-31.47%	-0.28
简单平均			-0.60%	4.30%	-4.60%	10.03%	-1.04%	-	-
中证1000			-1.70%	1.83%	-6.56%	-6.28%	-21.58%	-	-

管理人	上周超额收益	本月超额收益	上月超额收益	近半年超额收益	近一年超额收益	近三年超额收益	今年以来超额收益	去年超额收益
5%分位	-0.44%	-0.44%	-13.05%	-5.19%	-1.24%	18.62%	-8.84%	5.06%
25%分位	0.10%	0.10%	-6.08%	2.26%	11.26%	22.78%	-2.77%	13.17%
中位数	0.38%	0.38%	-2.76%	6.71%	16.00%	38.32%	1.72%	15.81%
75%分位	0.74%	0.74%	-0.60%	9.72%	21.64%	53.96%	4.49%	20.85%
95%分位	1.20%	1.20%	3.10%	15.09%	30.72%	101.65%	9.51%	27.34%

图表 14：股票中性产品表现

私募业绩周度跟踪 20240327-20240403									
股票中性									
公司/经理	细分策略	成立日期	近一周	近一月	2024年	2023年	2022年	最大回撤	夏普
稳博投资	灵活对冲	2020-07-14	2.08%	3.42%	2.29%	13.42%	16.44%	-5.44%	1.60
安子私募	灵活对冲	2022-02-11	1.25%	7.59%	19.29%	8.93%	/	-6.34%	1.83
托特私募	股票中性	2022-07-27	1.10%	1.19%	1.65%	11.30%	/	-2.08%	1.89
茂源资本	股票中性	2018-04-26	1.10%	3.88%	-1.60%	12.48%	-1.77%	-9.37%	1.41
信弘天禾	股票中性	2022-02-16	1.01%	3.35%	1.39%	15.37%	/	-5.86%	1.66
诚奇资产	股票中性	2019-10-18	0.84%	2.44%	-0.36%	8.36%	7.58%	-5.71%	2.30
顽岩资产	股票中性	2021-10-28	0.83%	1.50%	-2.70%	12.15%	/	-9.51%	1.40
同温层	股票中性	2020-05-25	0.81%	1.04%	2.77%	8.93%	4.96%	-1.94%	3.28
千衍私募	股票中性	2021-09-28	0.81%	4.89%	4.43%	17.44%	/	-5.09%	1.81
乾象私募	股票中性	2021-03-26	0.74%	3.45%	-3.03%	12.14%	13.78%	-12.20%	1.10
致诚卓远	股票中性	2017-11-17	0.64%	1.29%	1.01%	7.13%	8.82%	-5.08%	2.50
世纪前沿	股票中性	2019-10-21	0.58%	2.66%	1.84%	9.23%	6.01%	-8.86%	1.93
衍复投资	灵活对冲	2020-06-01	0.42%	2.86%	2.30%	13.47%	11.10%	-7.87%	2.10
蝶威资产	T0	2022-11-24	0.32%	1.34%	1.50%	7.77%	/	-1.63%	2.32
汇富联合	T0	2019-03-15	0.30%	0.49%	0.75%	4.26%	9.25%	-2.87%	2.93
衍合投资	股票中性	2020-08-25	0.11%	0.96%	0.48%	13.09%	-1.77%	-6.04%	1.44
子午投资	股票中性	2021-12-02	0.10%	2.57%	11.27%	7.21%	11.25%	-2.96%	2.32
希格斯	股票中性	2018-12-07	0.06%	0.83%	1.55%	10.53%	2.82%	-2.07%	2.81
宽德投资	股票中性	2015-02-05	-0.07%	2.12%	1.64%	16.29%	10.45%	-7.89%	1.94
金戈量锐	股票中性	2019-04-30	-0.13%	1.34%	-3.91%	7.30%	2.50%	-8.41%	1.12
简单平均			0.65%	2.46%	2.13%	10.84%	5.07%		
比较基准			0.68%	2.00%	-1.39%	5.40%	0.89%		

管理人	上周收益	本月收益	上月收益	近半年收益	近一年收益	近三年收益	今年以来收益	去年收益
5%分位	-0.60%	-0.60%	-0.05%	-5.20%	-1.87%	-1.56%	-8.01%	2.21%
25%分位	-0.34%	-0.34%	1.00%	1.05%	3.51%	18.51%	-2.19%	7.27%
中位数	-0.01%	-0.01%	1.86%	2.99%	7.78%	24.15%	0.72%	10.12%
75%分位	0.20%	0.20%	2.61%	5.86%	11.68%	31.21%	2.96%	12.65%
95%分位	0.63%	0.63%	4.39%	10.85%	16.43%	41.10%	7.98%	16.27%

图表 15：CTA 产品表现

私募业绩周度跟踪 20240327-20240403

量化CTA

公司/经理	细分策略	成立日期	近一周	近一月	2024年	2023年	2022年	最大回撤	夏普
水木长量	量化CTA	2019-11-28	4.11%	7.37%	8.02%	-10.09%	17.23%	-16.53%	1.04
元胜投资	量化CTA	2018-07-31	2.62%	5.23%	1.96%	-3.36%	1.62%	-5.87%	1.02
均成资产	量化CTA	2017-03-01	2.21%	5.29%	-0.47%	14.64%	27.08%	-22.47%	1.89
宏锡基金	量化CTA	2016-05-06	1.99%	8.55%	0.13%	4.15%	17.88%	-15.66%	0.91
艾方资产	量化CTA	2021-02-26	1.96%	3.65%	0.03%	0.72%	4.15%	-11.14%	0.63
千象资产	量化CTA	2017-12-27	1.92%	6.19%	2.42%	-2.97%	5.67%	-14.84%	0.89
芷瀚资产	量化CTA	2019-03-06	1.77%	1.86%	-2.00%	1.38%	12.63%	-9.17%	1.43
会世资产	量化CTA	2018-07-30	1.74%	4.73%	0.77%	-1.83%	6.16%	-17.56%	0.95
信弘天禾	量化CTA	2017-11-10	1.66%	3.85%	-2.00%	14.67%	5.91%	-8.83%	1.03
黑翼资产	量化CTA	2016-10-17	1.48%	8.42%	2.19%	11.77%	9.21%	-7.77%	1.53
涵德投资	量化CTA	2018-04-23	0.74%	0.38%	2.13%	-4.44%	6.04%	-8.33%	1.45
远瀚私募	量化CTA	2016-04-22	0.58%	-0.87%	-4.71%	32.74%	60.20%	-17.45%	0.87
御澜资产	量化CTA	2021-12-30	0.56%	1.11%	-0.64%	13.09%	86.29%	-18.41%	1.58
量游资产	量化CTA	2017-11-10	0.49%	3.12%	5.36%	-0.70%	10.28%	-5.42%	1.33
众壹资产	量化CTA	2021-08-09	0.08%	5.09%	6.05%	5.49%	3.50%	-12.30%	0.72
弘源泰平	量化CTA	2020-09-10	0.07%	3.47%	1.88%	14.08%	12.84%	-7.73%	1.51
凯丰投资	量化CTA	2021-02-09	-0.09%	2.23%	1.67%	9.05%	4.25%	-10.25%	1.10
九坤投资	量化CTA	2017-06-19	-0.13%	1.41%	1.68%	10.01%	-0.79%	-8.88%	1.32
佑维投资	量化CTA	2019-07-29	-0.14%	2.53%	4.27%	17.34%	9.10%	-8.38%	1.84
殊懿投资	量化CTA	2020-06-05	-0.80%	-0.48%	-0.86%	11.81%	4.47%	-4.71%	3.64
简单平均			1.14%	3.66%	1.39%	6.88%	15.19%		
比较基准			0.86%	2.69%	1.92%	1.24%	1.79%		

管理人	上周收益	本月收益	上月收益	近半年收益	近一年收益	近三年收益	今年以来收益	去年收益
5%分位	-0.86%	-0.86%	-0.95%	-10.50%	-5.72%	-3.65%	-6.85%	-10.09%
25%分位	-0.10%	-0.10%	0.86%	-2.50%	-1.57%	8.12%	-1.94%	-4.53%
中位数	0.42%	0.42%	2.39%	-0.61%	2.25%	14.36%	0.81%	0.53%
75%分位	0.80%	0.80%	5.15%	3.29%	8.33%	25.17%	3.37%	8.54%
95%分位	1.65%	1.65%	9.54%	13.31%	27.55%	54.88%	11.49%	17.60%

图表 16：套利策略产品表现

私募业绩周度跟踪 20240327-20240403

套利策略

公司/经理	细分策略	成立日期	近一周	近一月	2024年	2023年	2022年	最大回撤	夏普
哈希私募	套利策略	2022-09-26	1.29%	2.74%	5.00%	11.27%	/	-2.54%	2.54
青石资产	多策略	2022-09-05	0.76%	0.97%	5.24%	5.52%	/	-1.63%	2.37
量衍投资	套利策略	2021-11-15	0.49%	0.69%	0.90%	4.09%	8.28%	-2.47%	2.36
望晟投资	套利策略	2022-02-24	0.48%	0.68%	0.48%	6.55%	/	-2.09%	2.35
致同投资	套利策略	2017-03-17	0.35%	0.45%	0.17%	2.97%	8.97%	-6.40%	2.02
天宝私募	套利策略	2017-10-25	0.29%	0.48%	4.13%	4.54%	8.19%	-0.68%	2.95
量壹投资	套利策略	2020-12-31	0.29%	0.94%	4.76%	9.31%	29.07%	-0.52%	5.75
展弘投资	套利策略	2016-01-20	0.23%	0.65%	1.39%	4.80%	7.19%	-3.36%	3.33
盛冠达	套利策略	2020-06-01	0.22%	1.11%	4.03%	3.05%	3.40%	-0.91%	2.41
放牛人	套利策略	2022-03-04	0.21%	0.20%	1.85%	4.76%	/	-0.60%	5.28
同享投资	多策略	2020-03-30	0.21%	0.57%	1.01%	9.35%	13.69%	-2.09%	1.37
悬铃私募	套利策略	2018-11-19	0.16%	1.85%	-2.16%	5.52%	3.62%	-6.84%	2.00
鸣熙资产	套利策略	2020-04-16	0.16%	0.36%	4.66%	2.02%	10.66%	-2.61%	4.53
橡杉资产	套利策略	2020-06-08	0.15%	1.36%	2.83%	7.84%	8.80%	-0.60%	1.84
舜泽投资	套利策略	2019-09-02	0.06%	1.25%	-4.76%	4.73%	5.32%	-6.93%	2.71
摩旗投资	套利策略	2022-01-10	0.05%	0.19%	1.08%	4.23%	/	-0.54%	5.77
明道私募	多策略	2022-04-28	0.03%	0.12%	0.21%	8.62%	/	-1.24%	3.35
盛泉恒元	套利策略	2015-09-11	-0.29%	0.34%	-2.44%	9.72%	4.22%	-4.95%	2.24
御澜资产	套利策略	2019-06-28	-0.40%	-0.24%	-1.22%	1.23%	6.49%	-13.70%	0.75
殊懿投资	套利策略	2019-04-30	-0.74%	0.13%	-0.67%	3.96%	5.28%	-5.02%	1.99
简单平均			0.20%	0.74%	1.33%	5.70%	6.16%		
比较基准			0.15%	1.14%	-0.15%	3.45%	2.28%		

股指/ETF 套利管理人	上周收益	本月收益	上月收益	近半年收 益	近一年收 益	近三年收 益	今年以来 收益	去年收益
5%分位	-0.42%	-0.42%	-0.10%	-3.52%	-4.37%	8.86%	-4.81%	-0.03%
25%分位	-0.01%	-0.01%	0.37%	1.34%	2.30%	12.83%	0.31%	2.55%
中位数	0.06%	0.06%	0.74%	2.99%	4.46%	16.79%	1.59%	3.46%
75%分位	0.20%	0.20%	0.99%	5.55%	7.28%	20.33%	4.24%	4.71%
95%分位	0.32%	0.32%	2.73%	10.51%	12.54%	23.44%	8.71%	8.95%
CTA 套利 管理人	上周收益	本月收益	上月收益	近半年收 益	近一年收 益	近三年收 益	今年以来 收益	去年收益
5%分位	-3.65%	-3.65%	-9.10%	-15.11%	-14.80%	-4.00%	-8.84%	-18.38%
25%分位	-0.24%	-0.24%	-0.66%	-2.59%	0.38%	27.20%	-1.27%	2.37%
中位数	0.17%	0.17%	1.03%	-0.33%	5.01%	37.65%	0.72%	6.96%
75%分位	1.31%	1.31%	3.89%	3.57%	11.11%	52.58%	4.25%	13.63%
95%分位	2.94%	2.94%	7.38%	10.25%	23.11%	94.74%	8.23%	38.70%

图表 17：期权策略产品表现

私募业绩周度跟踪 20240327-20240403									
期权策略									
公司/经理	细分策略	成立日期	近一周	近一月	2024年	2023年	2022年	最大回撤	夏普
海狮资产	期权策略	2018-12-04	1.11%	4.28%	-2.64%	8.81%	-7.65%	-9.37%	0.80
小黑妞	期权策略	2019-06-10	0.70%	1.86%	1.88%	7.06%	3.35%	-3.21%	2.44
吾执投资	期权策略	2021-04-08	0.69%	-2.68%	-1.90%	-0.76%	6.57%	-7.18%	0.28
牧鑫资产	期权策略	2017-02-13	0.52%	2.74%	11.10%	4.52%	-1.71%	-8.90%	1.30
跃威私募	期权策略	2020-07-09	0.21%	2.63%	-0.19%	6.96%	8.41%	-2.82%	3.47
量客投资	期权策略	2020-07-14	0.15%	0.60%	2.02%	7.60%	7.99%	-2.35%	2.79
佳岳私募	期权策略	2020-11-04	0.13%	0.52%	-0.79%	5.29%	5.88%	-3.46%	2.25
青石资产	期权策略	2019-07-05	0.12%	0.33%	4.10%	6.05%	4.33%	-1.80%	2.14
庄贤投资	期权策略	2019-12-16	0.10%	0.66%	-0.19%	2.86%	1.36%	-3.35%	1.67
古木投资	期权策略	2021-12-20	0.10%	0.77%	2.27%	4.49%	17.63%	-3.09%	2.32
致远私募	期权策略	2021-12-20	0.09%	2.47%	1.04%	9.31%	5.30%	-2.81%	1.93
正赢资产	期权策略	2017-07-20	0.04%	1.64%	4.31%	5.20%	5.43%	-3.04%	2.90
绅瑞私募	期权策略	2019-11-20	0.01%	0.22%	3.41%	12.36%	14.82%	-0.68%	3.52
散享资产	期权策略	2017-01-05	/	0.72%	1.81%	12.31%	-1.99%	-4.26%	1.84
君宜私募	期权策略	2021-08-16	-0.11%	0.29%	0.84%	5.52%	13.60%	-1.48%	3.86
言起投资	期权策略	2020-02-20	-0.26%	0.04%	2.28%	1.96%	-5.05%	-8.76%	0.88
海利资产	期权策略	2014-12-24	-0.33%	-0.47%	-4.53%	6.18%	-0.49%	-5.38%	1.60
国优资产	期权策略	2021-06-09	-0.45%	0.94%	2.34%	-2.73%	41.07%	-11.17%	2.31
量游资产	期权策略	2020-03-26	-0.68%	1.74%	3.91%	8.69%	1.97%	-5.76%	2.07
林道资产	期权策略	2021-05-14	-0.87%	-2.20%	13.93%	-1.10%	10.46%	-19.35%	0.40
简单平均			0.06%	0.85%	2.25%	5.53%	6.56%		
比较基准			0.15%	1.14%	-0.15%	3.45%	2.28%		
管理人	上周收益	本月收益	上月收益	近半年收益	近一年收益	近三年收益	今年以来收益	去年收益	

5%分位	-0.38%	-0.38%	0.04%	-0.68%	0.80%	13.46%	-3.42%	-1.41%
25%分位	0.02%	0.02%	0.88%	1.68%	5.29%	18.12%	0.80%	5.20%
中位数	0.21%	0.21%	1.58%	4.21%	7.07%	19.48%	1.88%	6.05%
75%分位	0.33%	0.33%	2.33%	6.40%	8.04%	23.60%	3.66%	8.49%
95%分位	1.06%	1.06%	3.29%	8.60%	9.45%	46.35%	7.96%	11.76%

免责声明

本文件仅用于初始信息交流之目的，并不构成广告或销售要约，或买入任何证券、基金或其它投资工具的建议。

本文件内的例子仅供参考，概不保证任何特定投资目标将会达成或任何期望达致该等目标的投资策略将会成功。

本文件内的产品过去的表现不一定是未来业绩的指标，潜在投资者不应仅仅依赖本文件的内容作出投资决定。