|  |  |
| --- | --- |
| 时间 | 2024.03.22 17:00 |
| 管理人全称 | 上海磐松私募基金管理有限公司 |
| 代表策略(可多个) | 指数增强、多空对冲、市场中性 |
| 主讲人及职位 | 李新宇 市场总监 |
| 管理人简介 | 上海磐松私募基金管理有限公司成立于2022年，专注于权益类资产的主动管理。凭借着可持续的优秀业绩，我们为全球的机构客户提供主动资产管理服务和解决方案。公司由员工100%持股，稳定的团队让我们更注重客户的长期利益，更有效地落实受托责任。 虽然我们认为长期战胜市场是非常困难的，但是我们相信，如果一套完整的投资过程有效结合了富有洞见的投资逻辑和科学严谨的实证研究，就能创造出更优秀的收益风险比。市场是在不断变化的，再成功的投资模型也会随着竞争加剧、信息扩散逐渐失效。为了保证业绩的可持续性和维持投资过程的竞争优势，我们不断地在人员、数据、基础设施等方面再投资，持续地研究创新。  我们只有一个投研团队，团队成员来自于不同背景，高度分工却又紧密合作；我们只有一套预测模型，对所有可投资的标的资产及时更新逻辑一致的预测；我们只有一种投资过程，灵活的投资组合优化器同时为客户提供不同类型的权益产品，并可以通过专户定制来满足机构客户的特定需求。  基金业协会备案时间：2023年12月9日 |
| 代表性产品业绩 | 截至2024/3/21，  磐松中证500指数增强1号私募证券投资基金，交易日期2022/12/20，超额年化收益17.05%，超额最大回撤-10.15%，超额夏普1.97；  磐松多空对冲1号私募证券投资基金，交易日期2023/01/09，超额年化收益20.0%，超额最大回撤-3.83%，超额夏普2.98；  磐松市场中性1号私募证券投资基金，交易日期2023/08/23，超额年化收益14.8%，超额最大回撤-5.19%，超额夏普1.55； |
| 是否拥有投顾资格/预计何时取得（若无） | 暂无，有待公司拿到牌照满三年后 |
| 推荐理由 | 目前公司规模约50亿，指增策略23亿，多空对冲23亿，市场中性4亿，指增策略和市场中性策略容量在百亿以上，多空对冲容量大约为30亿。我们的核心投研团队深耕低频量化投资领域多年,且拥有丰富的期货投资经验。通过结合低频量化股票投资和股指期货趋势跟踪，投研团队将为广大投资者提供多样化、高收益风险比的投资产品。在当前错综复杂的股市行情下，这样的结合能够有效地降低投资组合的风险，控制市场层面的风险，从而使投资收益更加稳定。我们的低频策略与现有的高频量化策略业绩相关性普遍较低，而且容量远大于高频量化策略，对客户有较强的配置价值。 |
| 备注： | 代表产品实盘净值： |