

股票型/混合型基金优选

嘉因数科团队

时间：2022-11-18
类别：基金投资者

基金简介

本 FOF（Fund of Funds，基金中基金）产品通过短期投资于开放式股票型、混合型基金，获得显著优于沪深 300 指数的超额回报，能够在月度范围持续、较好地识别与选择基金，适合作为中长期持有的投资组合。

本产品在同一策略框架下，共提供 4 个选项，以迎合不同风险偏好。

资产类别
基金： 100%

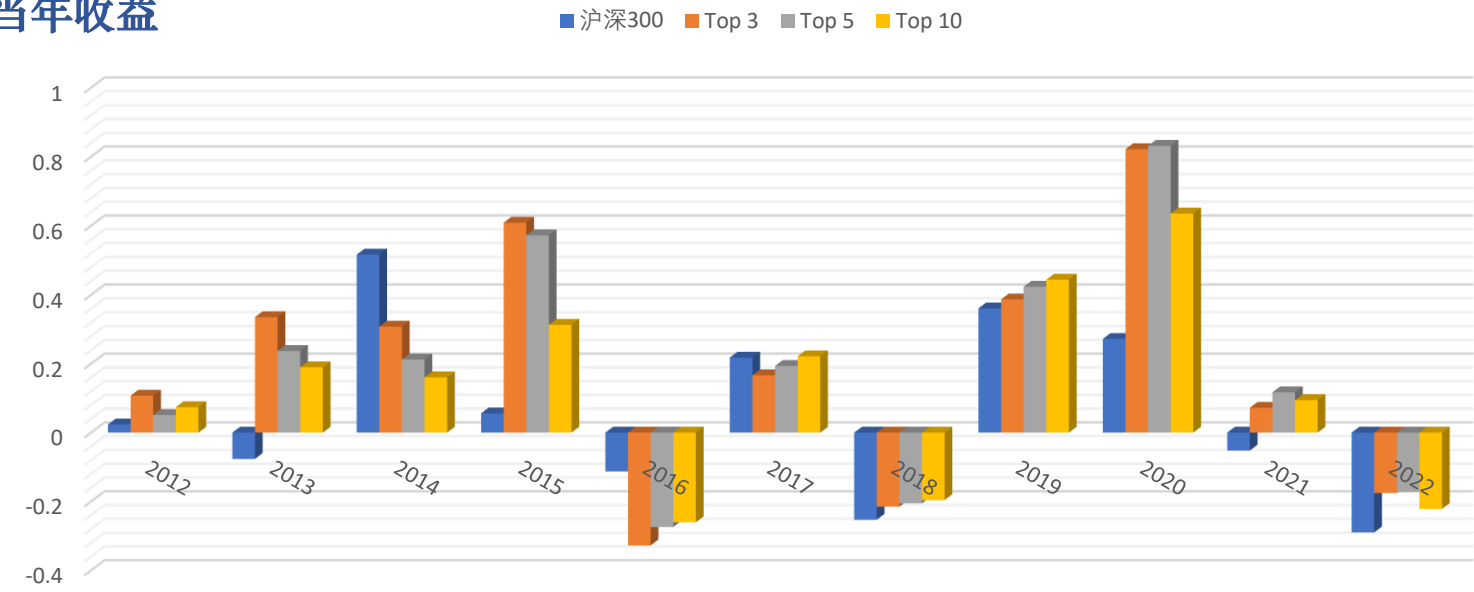
收益概览

	过去 1 月	过去 3 月	过去 6 月	累计收益	过去一年	过去三年（年化）	过去五年（年化）	过去十年（年化）
沪深 300	-7.78%	-15.86%	-12.64%	142.38%	-28.52%	-3.35%	-2.62%	4.52%
Top 3	-1.92%	-6.31%	12.25%	427.96%	-14.71%	19.11%	11.79%	14.77%
超额	5.86%	9.55%	24.89%	285.58%	13.82%	22.46%	14.41%	10.25%
Top 5	-1.89%	-8.27%	11.65%	411.64%	-15.71%	22.14%	13.83%	14.75%
超额	5.90%	7.59%	24.29%	269.25%	12.81%	25.50%	16.45%	10.23%
Top 10	-4.39%	-12.80%	3.89%	284.60%	-22.81%	13.29%	9.99%	10.56%
超额	3.40%	3.06%	16.52%	142.21%	5.71%	16.64%	12.61%	6.04%

基金属性

起始时间	2012 年 1 月
比较基准	沪深 300
主要市场	A 股市场

当年收益



基金选择

基金池	公募基金
基金类别	股票型或混合型
限制 1	非 ETF、非 QDII
限制 2	上市超一年
限制 3	股票占比>30%
限制 4	自由申购赎回
限制 5	规模>1 亿人民币
限制 6	优先选择 C 品种

注：

过往业绩不代表未来业绩

超过 12 个月的回报率按年化收益计算

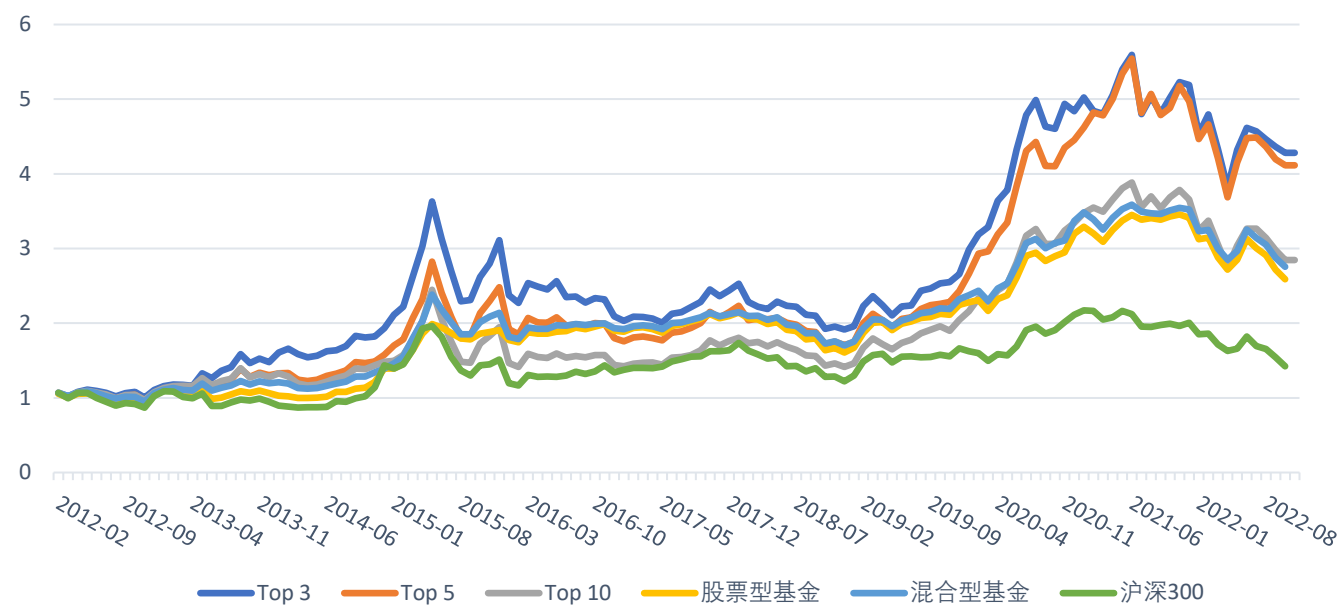
持仓采用“1/N”加权，每支基金在资产配置中占用资金量相等

股票型/混合型基金优选

嘉因数科团队

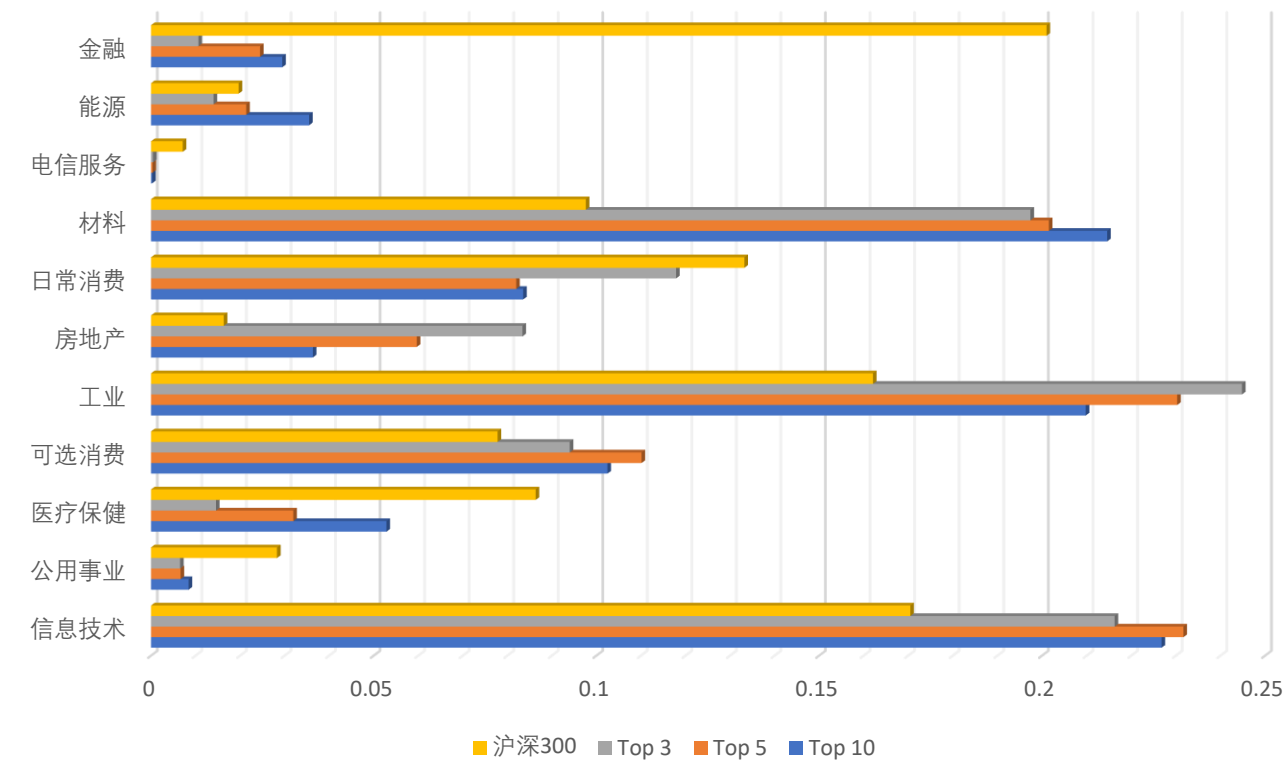
时间：2022-11-18
类别：基金投资者

净值表现



注：
过往业绩不代表未来业绩

行业权重



注：
沪深 300 行业权重选自 2022 年 11 月 18 日
本产品行业权重计算自 2022 年 11 月持仓（10 月 31 日晚）

风险收益

	收益率	波动率	夏普	贝塔
Top 3	14.77%	24.60%	0.60	0.93
Top 5	14.75%	23.58%	0.60	0.92
Top 10	10.56%	23.02%	0.45	0.93

注：
收益率、波动率、夏普（比率）均为年化值

11 月 Top 3/5/10 持仓

005094	万家臻选混合
001858	建信鑫利灵活配置混合
007193	恒越核心精选混合 C
000584	新华鑫益灵活配置混合 C
001997	工银新趋势灵活配置混合 C
519089	新华优选成长混合
206012	鹏华价值精选股票
000308	建信创新中国混合
002482	宝盈互联网沪港深混合
005262	鑫元欣享灵活配置混合 A

注：
11 月持仓计算自 10 月 31 日晚