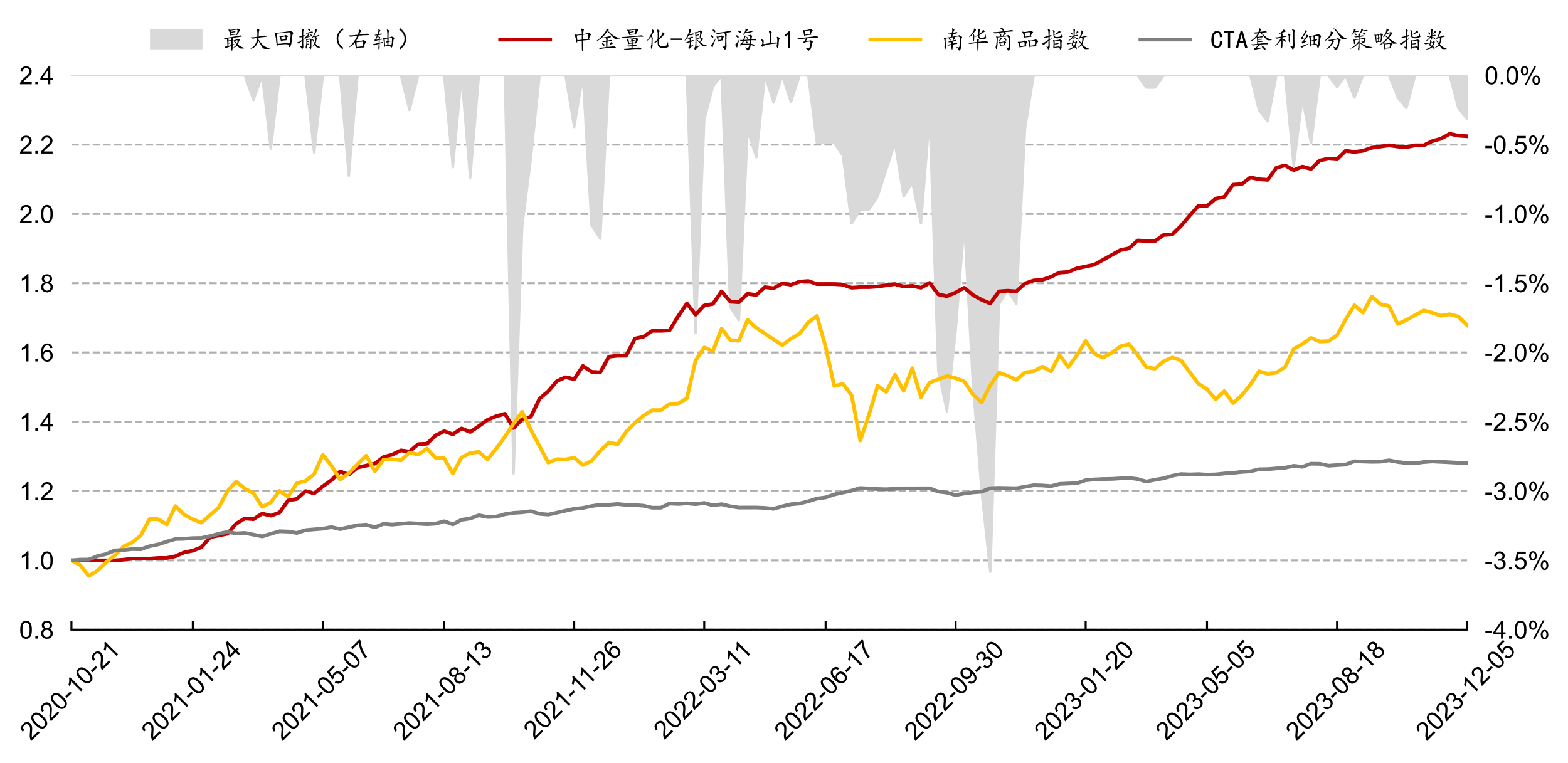
**1. 大禾投资-掘金1号**

****

数据来源：大禾投资，Wind;

分年度看，2021年从2月10日到年底收益26.3%、2022年收益1.4%、2023年截至12月6日收益14.2%。中金量化-汉江5号产品的胜率较高，除2022年之外，各年度均获得了不错的正收益，显著跑赢CTA套利细分策略指数，与南华商品指数不分伯仲。

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **指标** | **累计收益率** | **年化收益率** | **最大回撤** | **年化波动率** | **夏普比率** | **周胜率** |
| **大禾投资-掘金1号** | 952.4% | 39.0% | -58.9% | 34.8% | 1.1 | 54.1% |
| **年度** | **2017年** | **2018年** | **2019年** | **2020年** | **2021年** | **2022年** |
| **收益** | 79.8% | 99.0% | 115.3% | 47.7% | -10.3% | -7.4% |
| **年度** | **2023年** |  |  |  |  |  |
| **收益** | 4.4% |  |  |  |  |  |

数据来源：大禾投资，指标计算区间为2016年08月26日至2023年10月20日。