基金分析档案

产品名:半夏

制作时间: 2022-08-01

作者: 李楷

基金基本信息 历史复权净值及趋势图 基金简称 半夏 净值日期 2021-09-24 复权单位净值 1.6742 复权净值NAV 1.7 拟合趋势(Y+1) 策略类型 其中, Y=0.000799*X 1.6 修正R方=0.780895; 产品成立日期 产品名: 半夏 起始日期: 2020-07-17 净值日期: 2021-09-24 存续时间 1.5 基金管理人 1.4 管理人现存规模 1.3 管理人成立时间 1. 2 1.1 1.0 1000 OT

基金区间绩效指标结果														
2019	2020 收 2021 收		2022	全国	全区间:		回撤	最 20	艮 2019 最		2021	最 2	2022 最	
收益	益率 益率		收益	至 最为	最大回 撤前		低点日 大回		(回撤	大回撤	大回	撤	大回撤	
率					拍	N	期	期						
	12.25	% 40	5.26%		-5.4	15%	2021011	20210)40		-1.66%	-5.45	5%	
							5	2						
Shar	Shar	Shar	Shar	Shar	Sorti	Sorti	Sorti	Sorti	Sorti	Calm	Calm	Calm	Calm	Calm
pe 比	pe 比	pe 比	pe	pe 比	no比	no H	no no	no 比	no 比	ar 比	ar 比	ar 比	ar 比	ar 比
率	率	率	比率	率	率	率	比率	率	率	率	率	率	率	率
2018	2019	2020	2021	2022	2018	2019	2020	2021	2022	2018	2019	2020	2021	2022
		2.99	2.55				2.99	2.55				14.28	10.03	

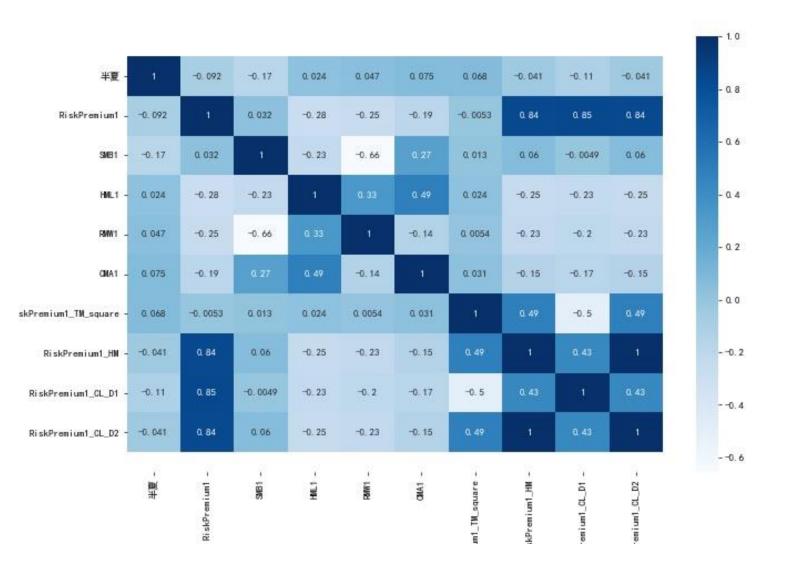
^{*}均为年化指标。平均超额收益率根据公募基金日度数据250天年化、私募周度数据52周年化的方式计算

基金复权净值变化的风格归因分析结果											
	选证	市场	市值	价值	盈利	投资	TM	修正			
	能力	风险	因子	因子 HML	因子	因子	择时	R方			
	Alpha	因子	SMB		RMW	CMA					
		RMF									
TM 模型	正	负相关(-	大盘(-0.7)	成长(-0.42)	低盈利(-	保守	正	0.05			
	向;(0.01)	0.12)			0.44)	(0.99)	向;(1.85)				
	选证	市场	市值	价值	盈利	投资	HM	修正			
	能力	风险	因子	因子 HML	因子	因子	择时	R方			
	Alpha	因子	SMB		RMW	CMA					
		RMF									
HM 模型	I	负相关(-	大盘(-	成长(-0.41)	低盈利(-	保守	正	0.05			
		0.26)	0.71)		0.44)	(0.99)	向;(0.27)				

	选证	市场	市值	价值	盈利	投资	CL	CL	CL	修正
	能力	风险	因子	因子	因子	因子	熊市	牛市	择时	R方
	Alpha	因子	SMB	HML	RMW	CMA	择时	择时		
		RMF					能力	能力		
CL 模型			大盘(-	成长(-	低盈利	保守	负向;(-	正	正	0.05
			0.71)	0.41)	(-0.44)	(0.99)	0.26)	向;(0.01	向;(0.27	
))	

^{*}基金数据(公募日度、私募周度)基于 Fama-French 五因子模型分别与 HM、TM、CL 模型的共同分析结果

风格因子相关系数图 (待改进中)



基于 Carhart 四因素模型的动量风格月度分析 (待进行)

与不同大类资产价格相关性的分析 (待进行)

针对指增策略的超额分析、以及中性策略相关跟踪市场指标(基差、利率)(待进行)

基于以上结论的,在基金同类排名的绩效分位数统计(缺数据库)、雷达图等图表展示绘制(待进行)