

# 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
策略类型	
产品成立日期	
存续时间	
基金管理人	
管理人现存规模	
管理人成立时间	



## 基金区间绩效指标结果

2019 收益率	2020 收益率	2021 收益率	2022 收益率	全区间最大回撤	最大回撤前日期	回撤最低点日期	2019 最大回撤	2020 最大回撤	2021 最大回撤	2022 最大回撤				
	12.25%	46.26%		-5.45%	20210115	20210402		-1.66%	-5.45%					
Sharpe 比率	Sharpe 比率	Sharpe 比率	Sharpe 比率	Sharpe 比率	Sorti 比率	Sorti 比率	Sorti 比率	Sorti 比率	Sorti 比率	Calm 比率	Calm 比率	Calm 比率	Calm 比率	Calm 比率
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

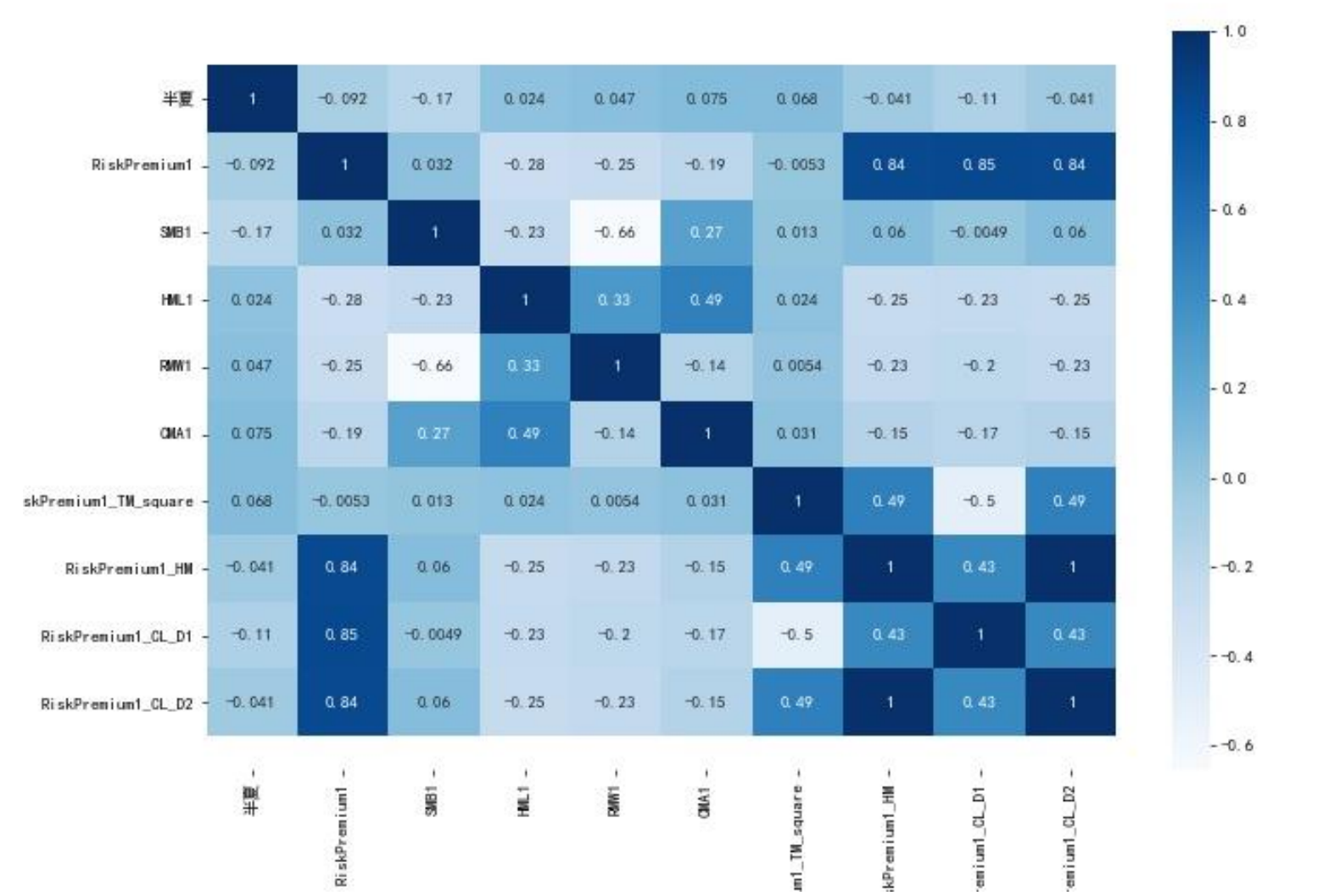
## 基金复权净值变化的风格归因分析结果

	选证能力 Alpha	市场风险因子 RMF	市值因子 SMB	价值因子 HML	盈利因子 RMW	投资因子 CMA	TM 择时	修正 R 方
TM 模型	正向;(0.01)	负相关(-0.12)	大盘(-0.7)	成长(-0.42)	低盈利(-0.44)	保守(0.99)	正向;(1.85)	0.05
HM 模型	选证能力 Alpha	市场风险因子 RMF	市值因子 SMB	价值因子 HML	盈利因子 RMW	投资因子 CMA	HM 择时	修正 R 方
		负相关(-0.26)	大盘(-0.71)	成长(-0.41)	低盈利(-0.44)	保守(0.99)	正向;(0.27)	0.05

CL 模型	选证能力 Alpha	市场风险因子 RMF	市值因子 SMB	价值因子 HML	盈利因子 RMW	投资因子 CMA	CL 熊市择时能力	CL 牛市择时能力	CL 择时	修正 R 方
			大盘(-0.71)	成长(-0.41)	低盈利(-0.44)	保守(0.99)	负向;(-0.26)	正向;(0.01)	正向;(0.27)	0.05

\* 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）