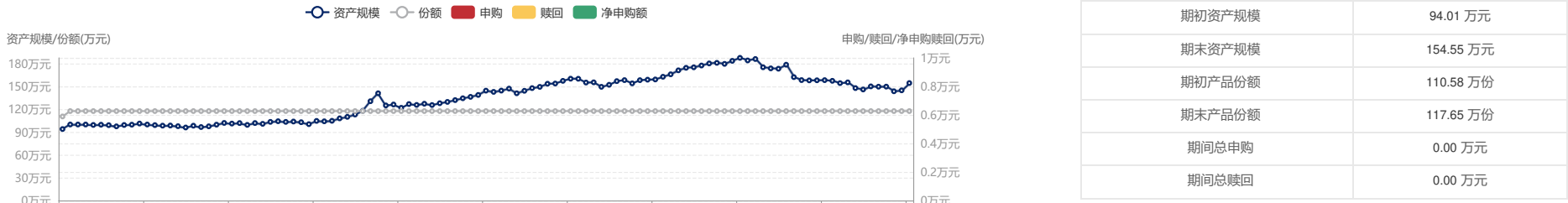


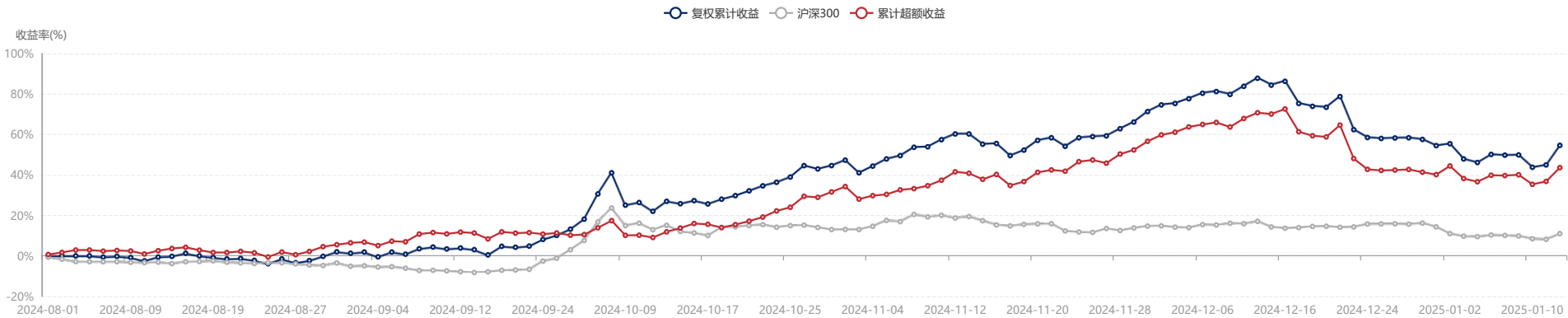
总体表现

产品名称	阳光安盛多禾一号私募证券投资	最新净值日期	2025-01-14	业绩统计	统计期间内产品总收益 <b>54.59%</b> (年化 <b>122.95%</b> )，主动收益 <b>43.59%</b> (年化 <b>98.18%</b> )，最大回撤 <b>-23.43%</b> ，夏普比率 <b>2.75</b> ， $\beta$ <b>1.05</b>
成立日期	2023-01-13	累计净值	1.3140		
当前规模	154.55万元	单位净值	1.3140	收益风险特征	绝对收益风险类型属于 <b>高收益高风险</b> ，主动收益风险类型属于 <b>高收益高风险</b> ，同等风险下获利能力 <b>较强</b>
投资策略	无	同策略收益排名	6.46%		

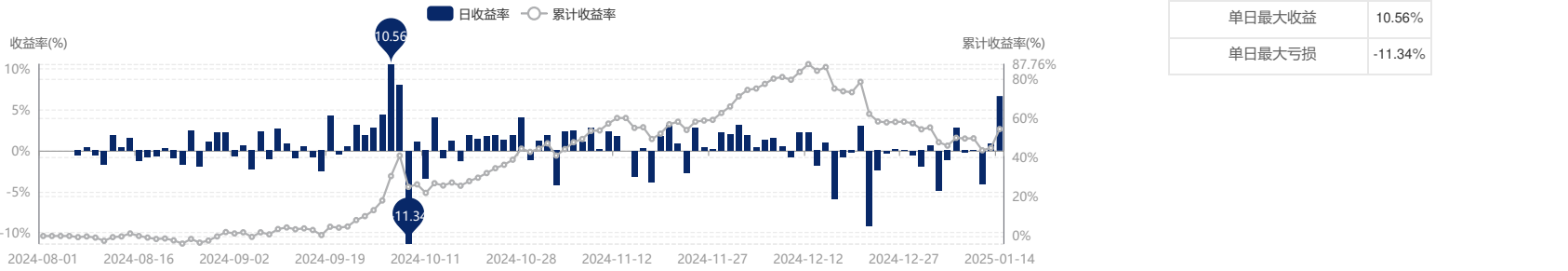
产品规模总览



单位净值表现

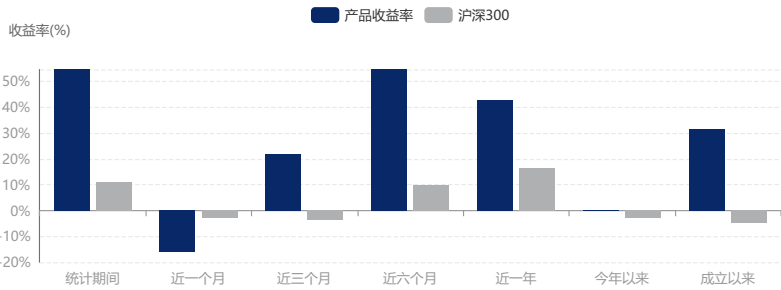


日收益表现



收益分析

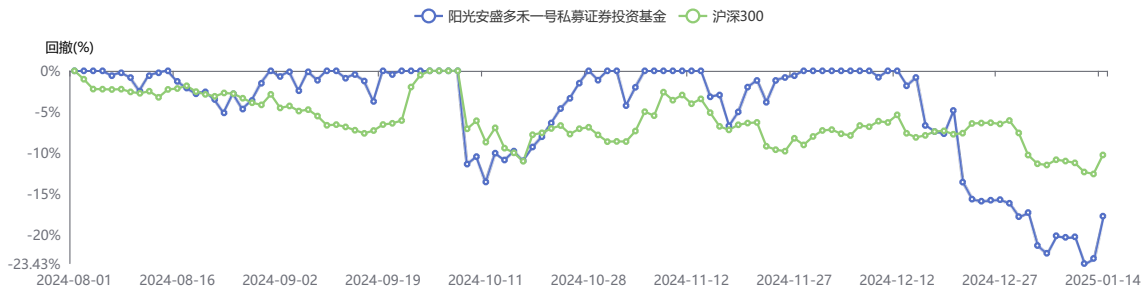
	*组合收益率(%)	*基准收益率(%)	*超额收益率(%)
统计期间	54.59	10.99	43.59
近一个月	-16.15	-2.86	-13.28
近三个月	21.78	-3.55	25.33
近六个月	54.59	10.03	44.56
近一年	42.67	16.33	26.34
今年以来	0.08	-2.91	2.98
成立以来	31.40	-4.91	36.31



指标分析

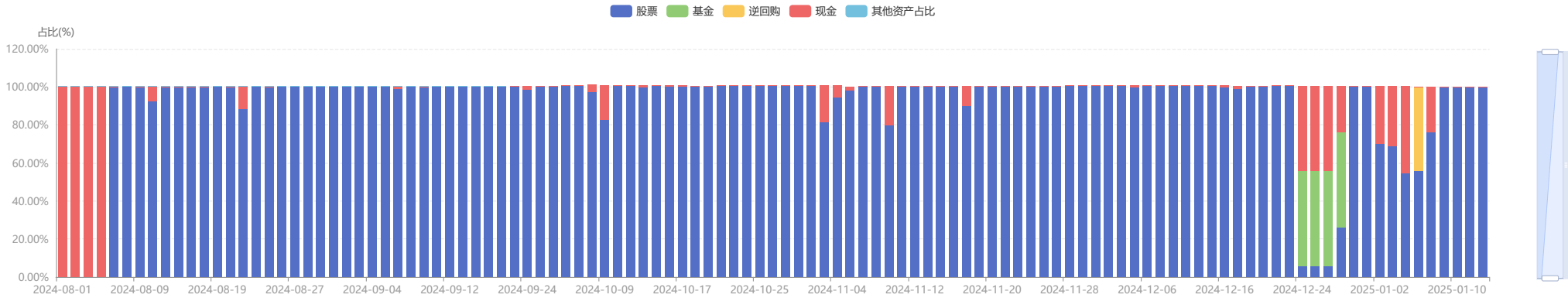
指标	统计期间	近一个月	近三个月	近六个月	近一年	今年以来	成立以来
*收益率(年化)	122.95%	-192.21%	83.77%	110.06%	44.08%	2.12%	16.19%
*波动率(年化)	44.10%	52.54%	40.09%	41.76%	30.39%	54.32%	22.03%
*跟踪误差(年化)	32.69%	50.36%	37.19%	31.33%	24.56%	41.50%	19.81%
*下行波动率(年化)	37.27%	44.51%	35.68%	37.27%	33.40%	35.13%	23.04%
*夏普比率(年化)	2.75	-3.69	2.05	2.59	1.39	0.01	0.66
*索提诺比率(年化)	3.25	-4.36	2.30	2.91	1.27	0.01	0.63
*信息比率(年化)	3.00	-3.14	2.62	2.87	1.11	2.00	0.94
*最大回撤	-23.43%	-22.80%	-23.43%	-23.43%	-23.43%	-7.49%	-23.43%
最大回撤期间	自2024-12-12 至2025-01-10	自2024-12-16 至2025-01-10	自2024-12-12 至2025-01-10	自2024-12-12 至2025-01-10	自2024-12-12 至2025-01-10	自2025-01-02 至2025-01-10	自2024-12-12 至2025-01-10
最大回撤修复期(月)	-	-	-	-	-	-	-
*卡玛比率	5.25	-8.43	3.58	4.70	1.88	0.28	0.69
周胜率	60.00	20.00	64.29	55.56	32.69	33.33	30.39
月胜率	83.33	50.00	75.00	71.43	38.46	100.00	32.00

动态回撤



产品期间最大回撤	-23.43%
比较基准的最大回撤	-12.54%
产品最大回撤区间	自2024-12-12至2025-01-10
比较基准的最大回撤区间	自2024-10-08至2025-01-13
产品最大回撤修复期	-
比较基准的最大回撤修复期	-

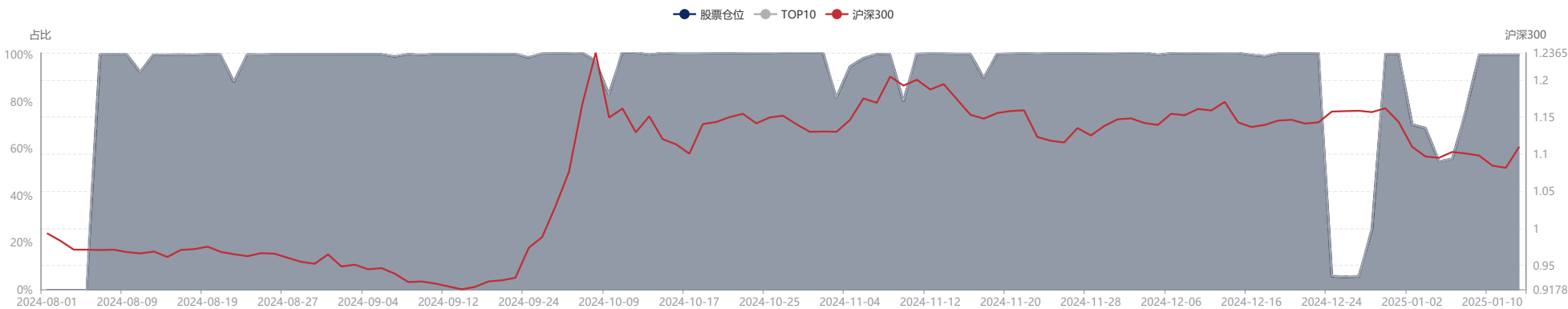
大类持仓时序



期末持仓

资产净值: 154.55(万元)					
资产总值: 154.61(万元)			负债合计: 0.06(万元)		
资产名称	资产市值(万元)	资产占比(%)	负债名称	负债市值(万元)	负债占比(%)
股票	154.35	99.87	正回购	0.00	0.00
债券	0.00	0.00	短期借款	0.00	0.00
公募基金	0.00	0.00	融资融券	0.00	0.00
定期存款	0.00	0.00	其他负债	0.06	100.00
逆回购	0.00	0.00			
期货(保证金/市值)	0.00/0.00	0.00/0.00			
期权市值	0.00	0.00			
理财产品	0.00	0.00			
场外衍生品(保证金/市值)	0.00/0.00	0.00/0.00			
现金	0.26	0.17			
其他资产	0.00	0.00			

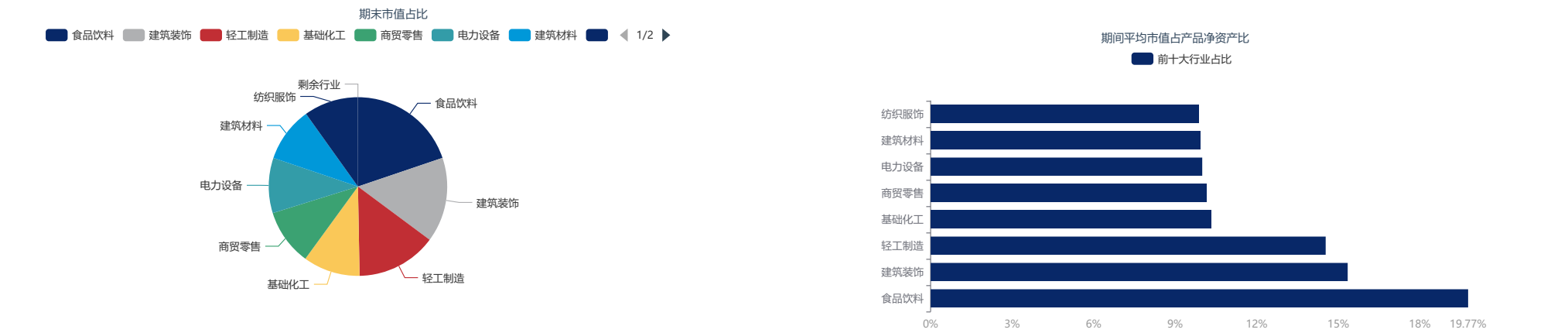
股票仓位时序\*



流动性资产时序\*



持股行业分析\*

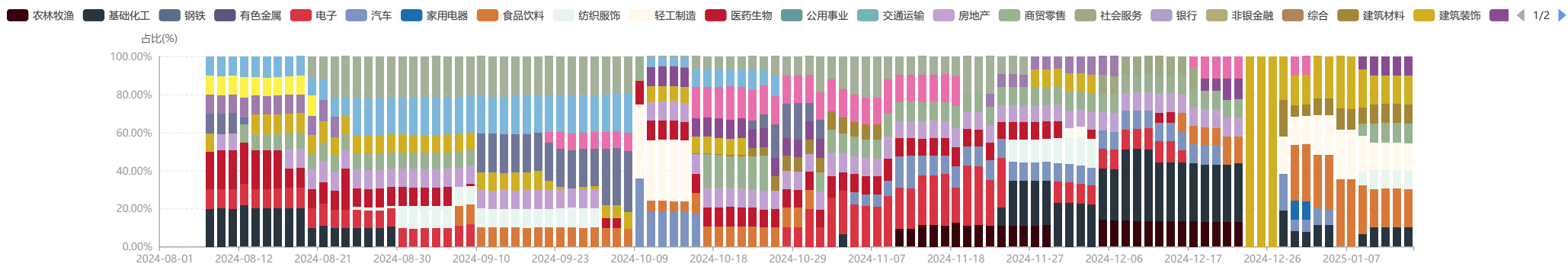


期末持股行业风格

分类	组合PE	组合PB	行业平均PE	行业平均PB	持仓市值(万元)	占比(%)
食品饮料	-21.79	2.01	21.10	4.65	30.55	19.80
建筑装饰	-13.72	1.68	9.58	0.78	23.71	15.36
轻工制造	-53.84	1.76	28.43	1.86	22.46	14.55
基础化工	-40.05	2.46	29.19	1.82	15.94	10.32
商贸零售	-7266.27	31.70	56.81	1.69	15.69	10.16
电力设备	-11.96	1.27	46.96	2.37	15.44	10.00
建筑材料	-4.63	3.45	34.76	1.02	15.33	9.93
纺织服饰	-11.37	3.83	21.76	1.72	15.24	9.87

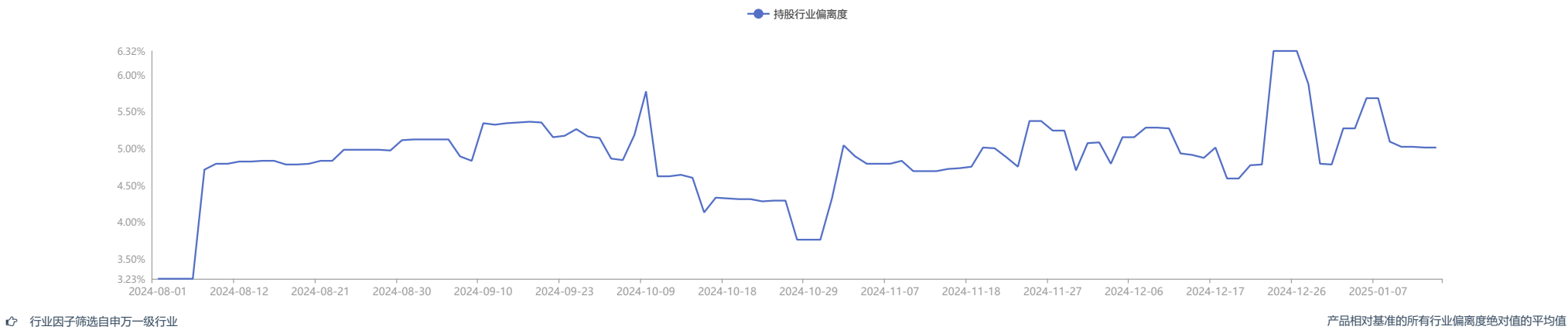
🔗 行业因子筛选自申万一级行业

持股行业占比时序



🔗 行业因子筛选自申万一级行业

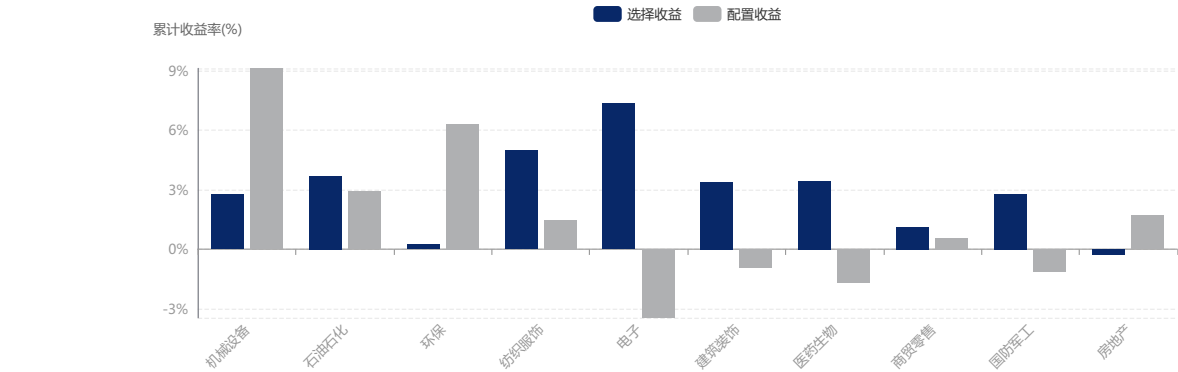
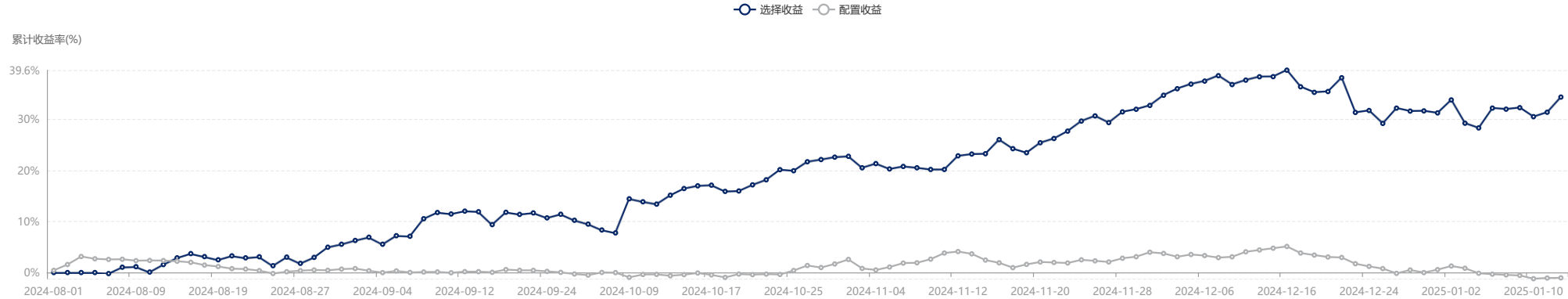
持股行业偏离度时序



大类资产绩效归因

资产类别	权重占净值比(%)	单位净值增长贡献(%)	收益率(%)	收益额(万元)	收益额贡献率(%)
股票	61.63	49.87	45.79	57.03	100.07
公募基金	1.20	-0.02	-0.05	-0.04	-0.07
逆回购	0.26	0.00	0.00	0.00	0.00

Brinson归因



行业因子筛选自申万一级行业

归因分析	
个股选择收益(%)	34.33
行业配置收益(%)	-1.04

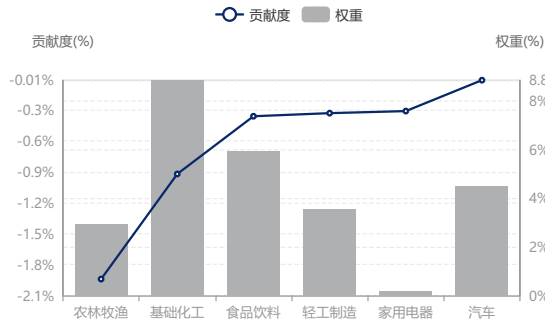
股票行业归因

按照收益额排名前十

行业	权重占净值比(%)	贡献度(%)	收益额(万元)	选择收益(%)	配置收益(%)
机械设备	3.92	10.78	12.87	2.76	9.11
纺织服饰	3.12	7.41	11.67	4.97	1.47
石油石化	6.46	7.59	8.81	3.68	2.92
电子	7.30	5.59	8.24	7.35	-3.45
医药生物	6.32	4.31	5.24	3.45	-1.67
环保	8.52	4.26	4.85	0.24	6.30
国防军工	1.93	2.36	3.41	2.79	-1.12
商贸零售	6.52	2.26	2.15	1.11	0.57
社会服务	0.80	1.10	2.02	0.50	0.46
电力设备	2.17	1.66	1.97	-0.27	-1.24

按照亏损额排名前十

行业	权重占净值比(%)	贡献度(%)	收益额(万元)	选择收益(%)	配置收益(%)
农林牧渔	2.96	-1.94	-3.61	-0.47	-1.20
基础化工	8.86	-0.92	-3.00	0.07	-1.77
食品饮料	5.94	-0.36	-2.42	0.10	-0.53
轻工制造	3.57	-0.33	-0.71	3.71	-4.34
家用电器	0.18	-0.31	-0.50	-0.19	-0.85
汽车	4.52	-0.01	-0.04	3.66	-4.35

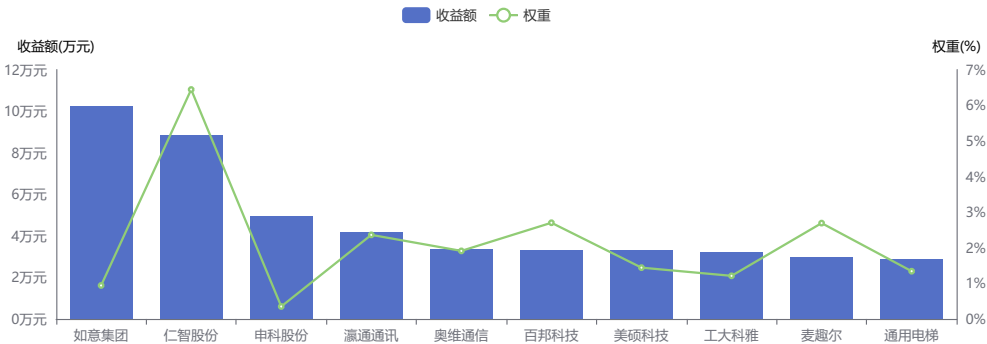


行业因子筛选自申万一级行业

股票绩效归因

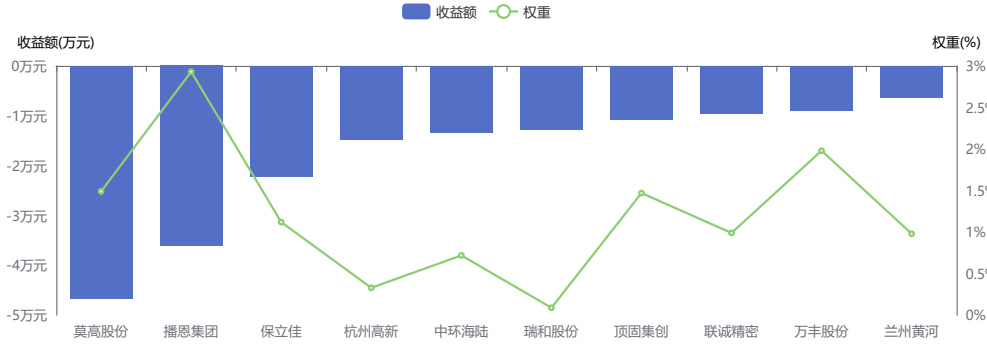
盈利前十

股票代码	股票名称	权重占净值比(%)	贡献度(%)	收益额(万元)
002193	如意集团	0.94	10.21	10.21
002629	仁智股份	6.44	8.81	8.81
002633	申科股份	0.35	4.91	4.91
002861	瀛通通讯	2.36	4.16	4.16
002231	奥维通信	1.91	3.35	3.35
300736	百邦科技	2.70	3.31	3.31
301295	美硕科技	1.44	3.31	3.31
301197	工大科雅	1.21	3.20	3.19
002719	麦趣尔	2.69	2.94	2.94
300931	通用电梯	1.34	2.84	2.84

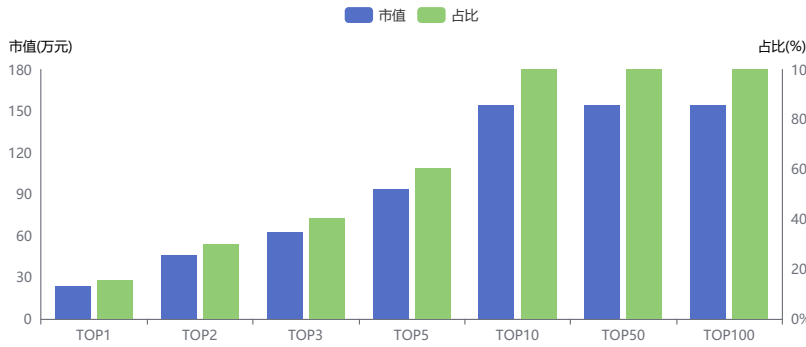


亏损前十

股票代码	股票名称	权重占净值比(%)	贡献度(%)	收益额(万元)
600543	莫高股份	1.49	-4.67	-4.67
001366	播恩集团	2.93	-3.61	-3.61
301037	保立佳	1.12	-2.22	-2.22
300478	杭州高新	0.33	-1.48	-1.48
301040	中环海陆	0.72	-1.34	-1.33
002620	瑞和股份	0.09	-1.27	-1.27
300749	顶固集创	1.47	-1.08	-1.08
002921	联诚精密	0.99	-0.96	-0.96
603172	万丰股份	1.98	-0.90	-0.90
000929	兰州黄河	0.98	-0.64	-0.64



个股持仓节点

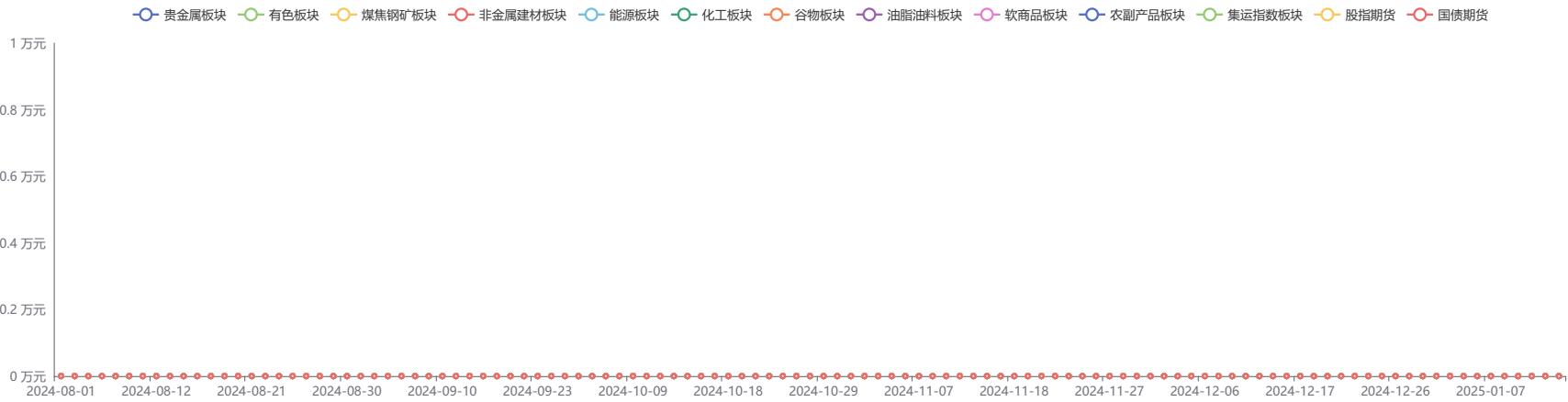


节点	市值(万元)	占比(%)
TOP1个股	23.71	15.36
TOP2个股	46.17	29.91
TOP3个股	62.11	40.24
TOP5个股	93.23	60.40
TOP10个股	154.35	100.00
TOP50个股	154.35	100.00
TOP100个股	154.35	100.00

期货分类归因

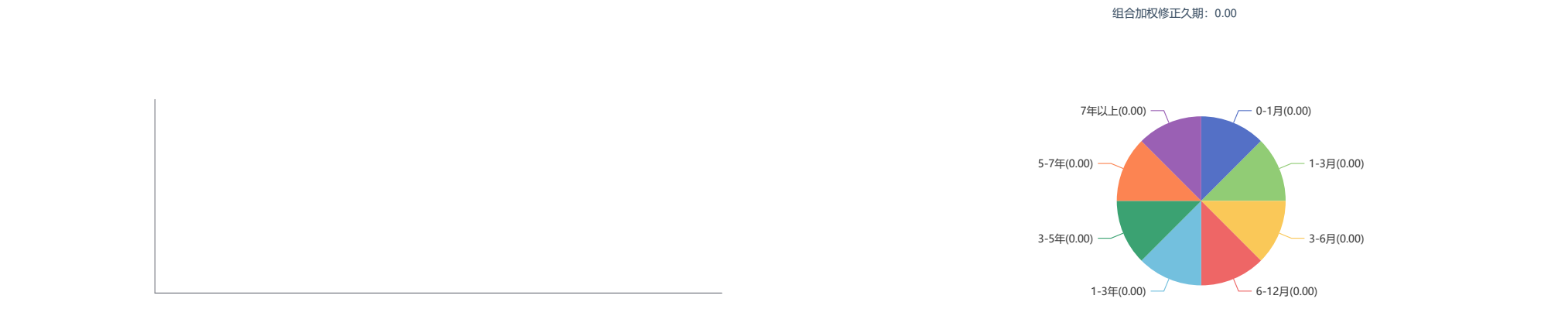
资产分类	*权重(占净值比%)	*单位净值增长贡献(%)	*收益率(%)	费前收益额(万元)	费后收益额(万元)	收益额贡献率(%)
股指期货	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
商品期货	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
国债期货	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

期货板块归因

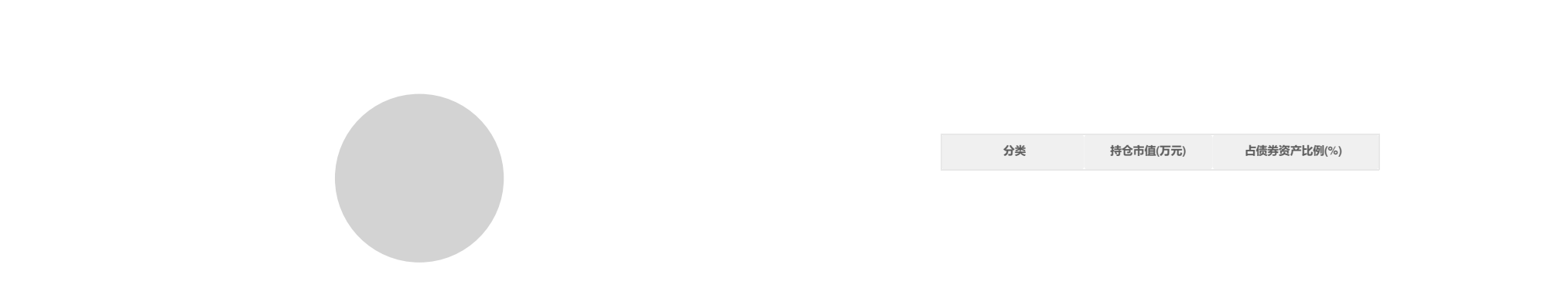


	贵金属板块	有色板块	焦煤煤矿板块	非金属建材板块	能源板块	化工板块	谷物板块	油脂油料板块	软商品板块	农副产品板块	集运指数板块	股指期货	国债期货
日平均多头持仓 (万元)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
多头收益额 (万元)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
日平均空头持仓 (万元)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
空头收益额 (万元)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
期间收益额 (万元)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
板块指数涨跌 (%)	9.86	-1.48	-6.36	-4.19	4.30	-0.42	-2.72	-0.26	-4.81	-8.77	-59.07	-	-

评级分布&久期分布



债券行业分布\*



债券策略\_债券收益风险分析

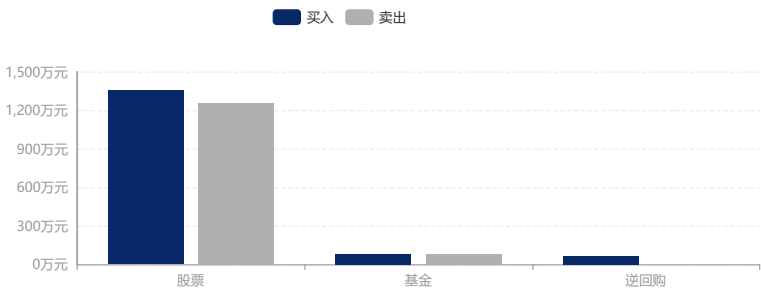


换手率（年化）\*

资产分类	统计期间(%)	近一个月(%)	近三个月(%)	近六个月(%)	今年以来(%)	成立以来(%)
股票	4438.91	5133.34	4444.51	3973.54	2789.61	1669.18
基金	450.33	2380.34	769.03	403.12	0.00	103.07
逆回购	225.23	1190.48	384.62	201.61	2777.78	51.55

期间交易

资产分类	买入金额(万元)	卖出金额(万元)
股票	1,353.91	1,257.53
基金	79.19	79.15
逆回购	66.10	0.00



前十大买卖期货

期货品种	交易金额(万元)	多头		空头		总盈亏(万元)
		数量(万手)	金额(万元)	数量(万股)	金额(万元)	
		查询无数据				