

业绩表现

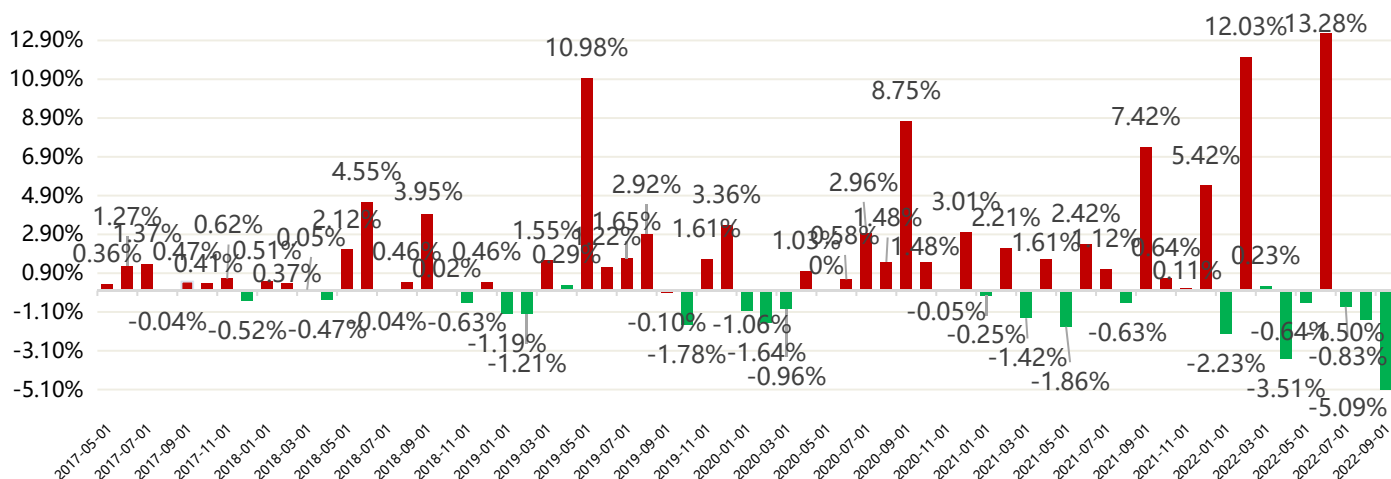
估值日期	2022-9-30
份额净值(元)	1.0027
份额累计净值(元)	1.9311
复权累计净值(元)	2.1164
本季度收益率	-7.29%
今年以来收益率	10.27%
成立以来收益率	111.64%
成立以来复合年化收益率	14.81%
夏普比率	1.06

众壹量合乾坤一号基金业绩表现



注: 1、份额净值, 是每份基金单位的净资产价值, 等于基金的总资产减去总负债后的余额再除以基金全部发行的单位份额总数。
2、份额累计净值=份额净值+基金成立后累计份额分红金额。

量合乾坤月度收益(%)



产品配置

量合乾坤一号三季度投资运作回顾:

- 1、乾坤一号基金在三季度出现一定回撤。三季度产品取得-7.29%的收益(三季度沪深300指数下跌15.16%), 今年以来收益率目前达到10.27%。今年以来跑赢沪深300指数33.24%。体现了产品复合策略在市场异常艰难的阶段具备明显防守性的风格特征。
- 2、策略配置层面, 乾坤一号在三季度约40%的仓位配置了量化股票多头策略, 约25%的仓位配置了量化CTA策略, 约10%的仓位配置了农产品套利策略。整体策略组合在三季度受到了股市大幅单边下跌行情的负面影响; 同时, 量化CTA策略受到商品市场在三季度的持续震荡行情影响也出现了小幅回撤; 三季度农产品套利策略提供了较稳健的收益。整体来看, 乾坤一号配置的各类子策略相关性极低, 仍起到了较好的分散配置、对冲的效果。
- 3、后市, 我们判断国内证券市场的估值已跌到近十年来的相对极低的位置, 市场进一步下跌空间及其有限, 继续大幅下跌的概率很低。商品市场在震荡盘整了3个月左右后, 随着宏观方向的愈加明朗, 商品将逐渐回归基本面定价逻辑。部分品种四季度肯恩出现独立性的行情走势。因此, 乾坤一号的各类子策略在四季度大概率存在净值明显修复的机会。

基金名称	众壹量合乾坤一号私募证券投资基金
基金管理人	上海众壹资产管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
基金期限	20年
开放日	每个交易日开放申购 每周三和五开放赎回(遇节假日顺延)
风险收益特征	本基金属于R4级(中高风险)投资品种
预警线/平仓线	0.80/0.75
参与最低金额	认购/首次申购最低金额: 100万元, 追加金额不低于1万元
基金费率	管理费: 1.5%/年, 申购费: 1% (价外) 持有 < 180天, 赎回费1%; ≥180天, 赎回费0, 托管费+服务费: 0.20%/年; 业绩报酬: 当基金份额赎回、基金终止或分红时, 管理人将提取赎回份额或分红份额当期收益的20%作为业绩报酬。