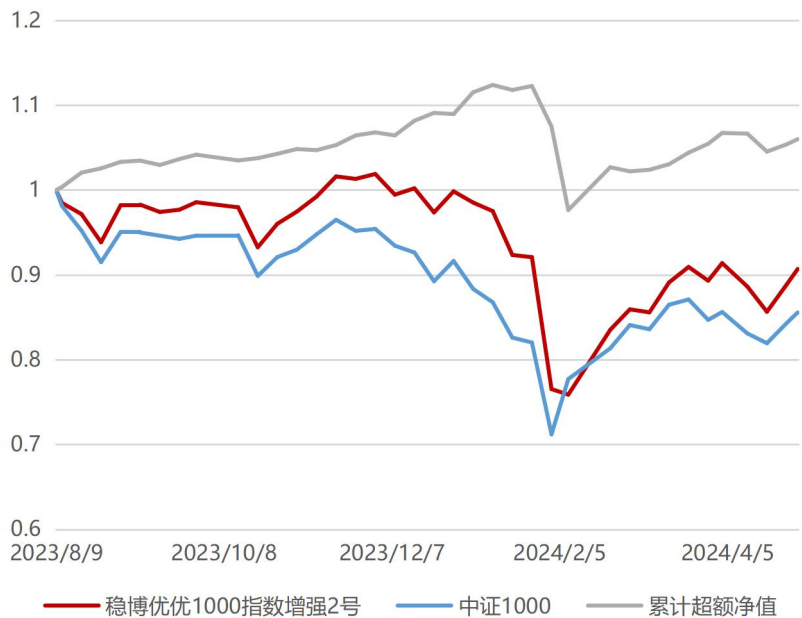


稳博优优 1000 指数增强 2 号私募证券投资基金

产品编号	SB1848	成立日	2023 年 7 月 28 日
策略类型	指数增强	建仓日	2023 年 8 月 9 日
基金经理	殷陶	到期日	2038 年 7 月 27 日
管理人	上海稳博投资管理有限公司	份额锁定	12 个月
代销机构	东方财富证券、天天基金	开放日	每自然月的最后一个周三
托管机构	招商证券股份有限公司	报告收益区间	2024 年 03 月 29 日-2024 年 04 月 30 日

产品业绩展示

单位净值	0.9069
累计净值	0.9069
复权净值	0.9069
本月收益率	1.55%
本月超额	0.51%
今年以来绝对收益	-9.16%
运作以来绝对收益	-9.26%
运作以来年化收益	-12.76%
今年以来累计超额	-2.72%
运作以来累计超额	5.99%
运作以来年化超额	8.52%
运作以来超额夏普	0.47
运作以来最大超额回撤	13.12%
运作以来超额周胜率	70.27%



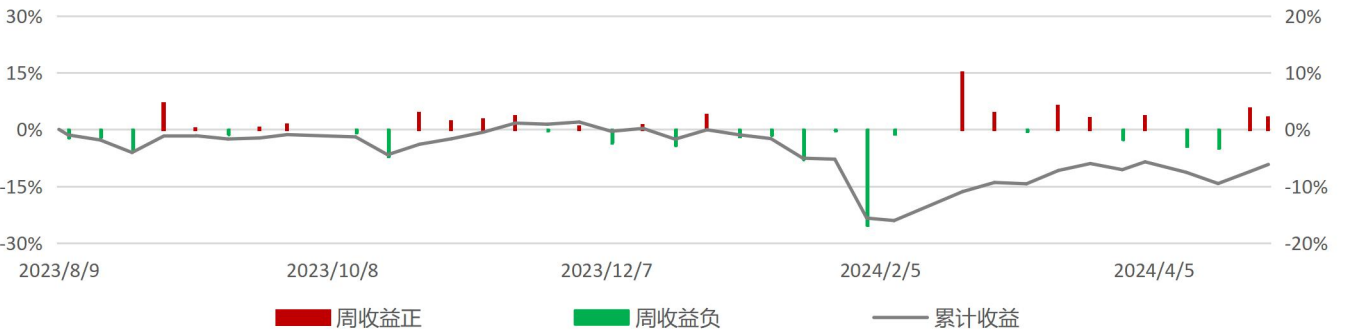
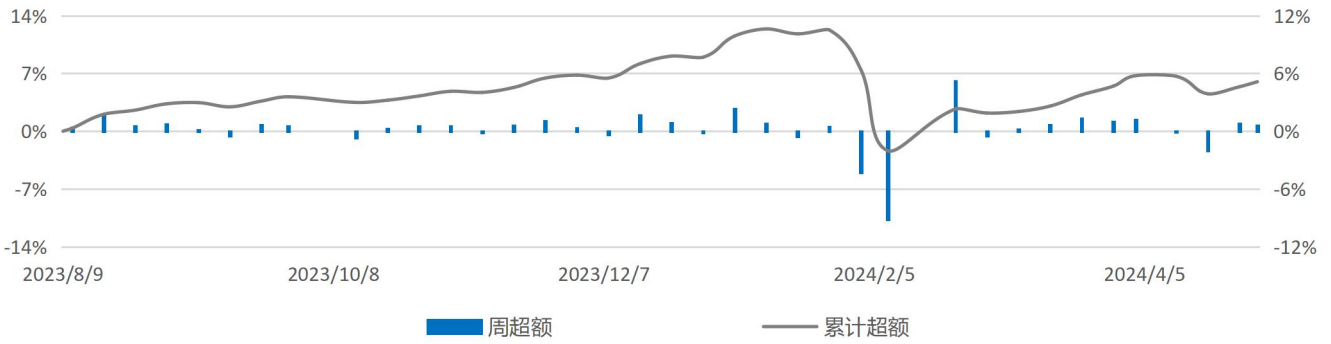
产品超额表现

月份	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	累计
2023月收益								-6.10%	5.03%	-2.58%	5.51%	-1.45%	-0.10%
2023月指数								-8.44%	3.40%	-2.67%	3.36%	-3.73%	-8.31%
2023月超额								2.55%	1.58%	0.09%	2.08%	2.37%	8.96%
2024月收益	-7.77%	-9.30%	6.93%	1.55%									
2024月指数	-10.49%	-0.84%	4.13%	1.03%									
2024月超额	3.03%	-8.53%	2.70%	0.51%									

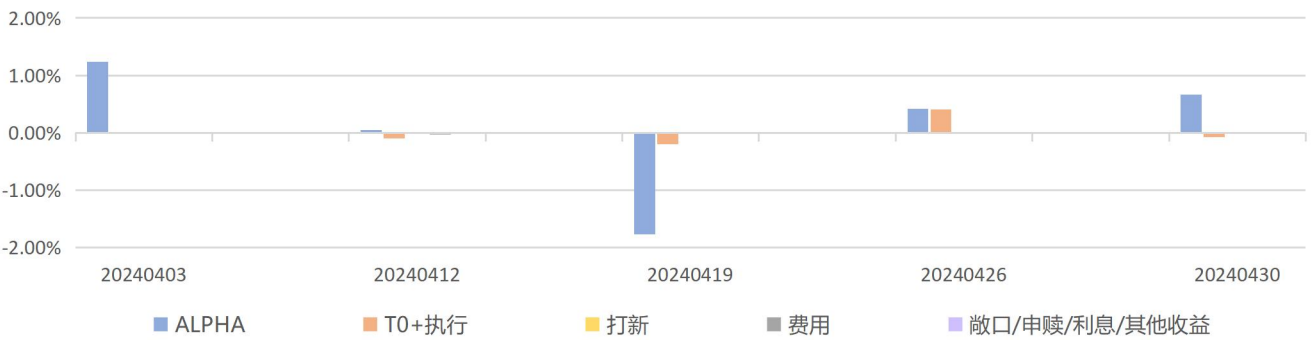
风险提示: 1、数据按周频取值 (每周最后一个交易日净值) 为计算依据, 仅供参考。

2、投资有风险, 请投资人慎重做决策。历史业绩不代表未来走向, 也不作为产品买卖投资建议。

3、根据合规要求, 私募基金相关信息严禁向非合格投资者披露, 亦不能通过各种形式公开宣传。



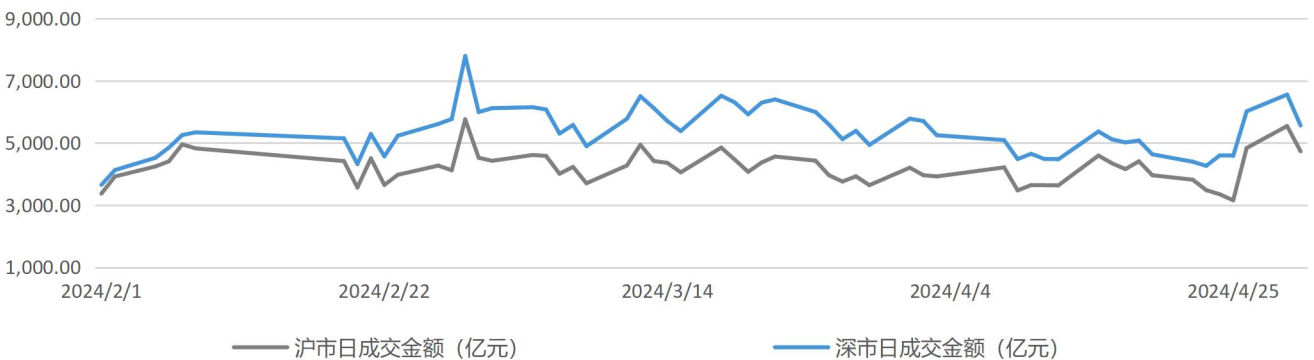
区间收益拆解



* 执行: 换仓交易

市场行情数据

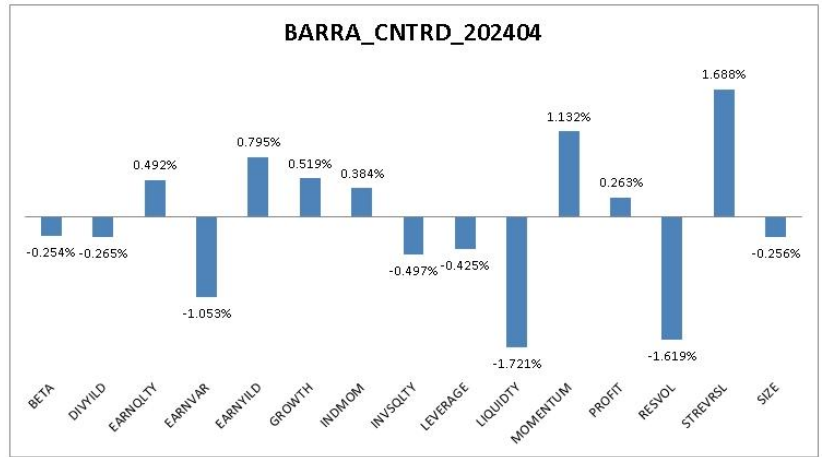
指数	中证500	中证1000	沪深300	创业板指	科创50	双创50
月度指数表现	2.93%	1.03%	1.89%	2.21%	0.62%	1.31%



- 风险提示: 1、数据按周频取值 (每周最后一个交易日净值) 为计算依据, 仅供参考。
 2、投资有风险, 请投资人慎重做决策。历史业绩不代表未来走向, 也不作为产品买卖投资建议。
 3、根据合规要求, 私募基金相关信息严禁向非合格投资者披露, 亦不能通过各种形式公开宣传。

BARRA 风格表现

4月 BARRA 风格因子表现如下，短期反转因子、动量因子、盈利能力因子表现强势，因子收益率为正；流动性因子、残差因子、盈利变动率因子表现较弱，因子收益率为负。



月度市场观点与策略分析

4月市场呈V型震荡，上证50、沪深300、中证500、中证1000收涨，中证2000收跌。从风格表现看，大小盘均衡，成长价值均衡。从基差看，IM、IC合约月末迅速升水，期指对冲端成本兑现。4月市场对“国九条”产生较大分歧，V型震荡后，年报落地叠加国际资金回流预期，有望促成A股中线级别估值修复。

未来将继续发扬工匠精神，深入研究并丰富因子，持续更新迭代模型。同时，加大软硬件设施的投入，提升整体运算和执行效果。

管理人简介

上海稳博投资管理有限公司于2014年成立，于2015年12月取得私募证券投资基金管理人资质，2020年10月，成为基金业协会观察会员。作为一家专业的投资机构，稳博投资业务范围涉商品期货投资、股指投资、证券投资等诸多领域。公司的发展愿景是成为国内乃至世界一流的资产管理公司，通过科学的投研体系、严谨的风控体系、高效的运作体系、完善的客服体系及自主研发量化软件的团队，为少数投资人提供资产增值服务，为不同风险类型的客户提供适合的资产管理产品。

上海稳博投资拥有一支经验丰富的专业化投研团队，团队核心背景为上海交通大学计算机和金融方面顶尖复合型人才；利用上海稳博投资独创的量化投资模型，通过对经济数据的分析，对期货、股票、股指等大类资产周期性波动变化的研究，运用大数据分析以及统计概率的基本思想，研发了高频量化策略、趋势策略、波段策略、套利策略等多元化的投资方式，为投资者提供其适合的资产管理产品。

基金经理简介

殷陶，稳博创始人，本科上海交通大学计算机专业，上海交通大学工学博士。创立初期使用完全自创的方法进行高频交易获得可观收益。中期构建了基于人工智能机器学习的研究方法体系带领稳博在多个高频交易品种交易占比遥遥领先。目前担任股票alpha负责人，进一步融合各家世界顶尖机构方法，形成了具有稳博特色的以多因子为基础融合人工智能机器学习方法的量化研究和交易体系。

风险提示：1、数据按周频取值（每周最后一个交易日净值）为计算依据，仅供参考。

2、投资有风险，请投资人慎重做决策。历史业绩不代表未来走向，也不作为产品买卖投资建议。

3、根据合规要求，私募基金相关信息严禁向非合格投资者披露，亦不能通过各种形式公开宣传。