

产品要素	
产品简称	中证 500 指数增强 FOF1 号
成立日期	2020-12-29
净值日期	2024-05-31
单位净值	1.0446
本月涨幅	-0.97%
今年以来收益	-9.50%
成立以来收益	4.45%
年化波动率	17.07%
夏普比率	-0.01
最大回撤	-30.84%
投资经理	景殿英
对比指标	中证 500

净值走势



区间收益表	今年以来	近一个月	近三个月	近半年	近一年	成立以来	年化收益
中证 500 指数增强 FOF1 号	-9.50%	0.17%	5.81%	-11.01%	-9.62%	4.45%	1.28%
中证 500	-2.22%	-2.44%	-0.72%	-4.27%	-12.22%	-14.38%	-4.44%

持仓配置	
私募基金	100.1%
股票资产	0.0%
债券资产	0.0%
期货保证金	0.0%
现金类资产	0.1%
其他	-0.2%
总计	100.0%

策略配置



年份	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	YTD
2024	-7.94%	-7.10%	6.13%	0.68%	-0.97%	-	-	-	-	-	-	-	-9.50%
2023	6.33%	2.63%	-1.06%	-1.70%	-0.28%	2.05%	0.61%	-6.12%	3.41%	-1.96%	3.93%	-1.67%	5.70%
2022	-9.26%	3.21%	-5.97%	-10.14%	5.97%	8.64%	2.21%	0.12%	-9.65%	0.47%	4.96%	-2.28%	-13.21%

运作情况及后市看法

5 月份，权益市场震荡下行。截止到 5 月底，万德全 A 下跌 1.21%，沪深 300 下跌 0.68%，中证 1000 下跌 2.59%，大盘强于小盘，价值优于成长。权益市场各大宽基指数的估值仍处于低估区间，两市成交逐渐走弱，期末维持在 7000 亿附近，市场波动率及振幅持续下降。股指期货基差在 5 月份持续走阔，期末各合约基差有所加深，期末 IF 主力合约年化基差在 0.78% 左右，IC 主力合约年化基差在 -3.5% 左右，IM 主力合约年化基差在 -9% 左右，贴水位于历史中高水平。海外方面，美国经济数据走弱，市场对 24 年美联储的政策预期有所转变。美股 5 月迎来了一轮上涨，道琼斯工业指数 5 月上涨了 2.3%，纳斯达克指数上涨了 6.88%。5 月虽然两市成交走弱，但市场风格较为延续，使得多头端的 alpha 收益有所恢复。

风险提示：

- 1、本报告含有第一创业证券股份有限公司权益投资管理部的保密信息，仅限产品委托人特定合作目的使用，任何主体不得擅自使用、复制、披露本报告任何内容；
- 2、过往业绩不代表管理人及产品未来表现，不构成管理人对收益的承诺和保证，请投资者关注产品投资风险；
- 3、本报告仅供参考，具体信息以产品的实际运作情况为准，如有任何疑问，请及时联系我司工作人员。