

银华量化益成系列产品季报

(2023/12/31—2024/03/31)

市场情况

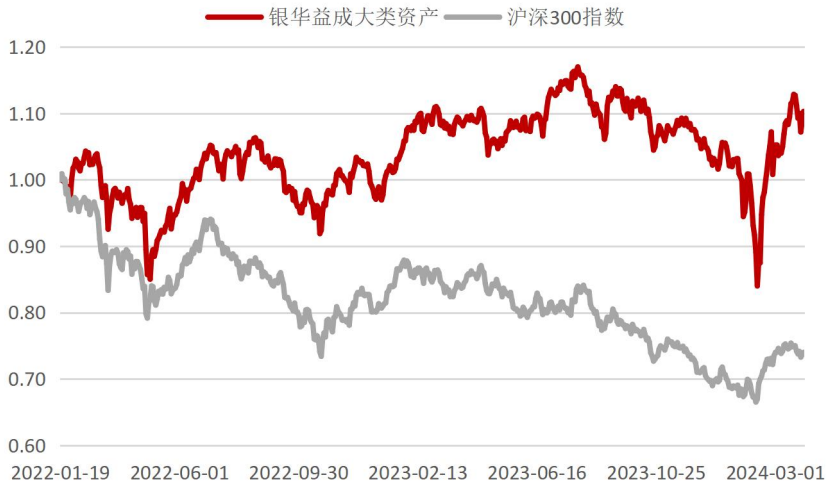
	上证 50	沪深 300	中证 500	中证 1000	中证 2000	红利指数
季度收益率	3.82%	3.10%	-2.64%	-7.58%	-11.05%	10.12%

产品表现

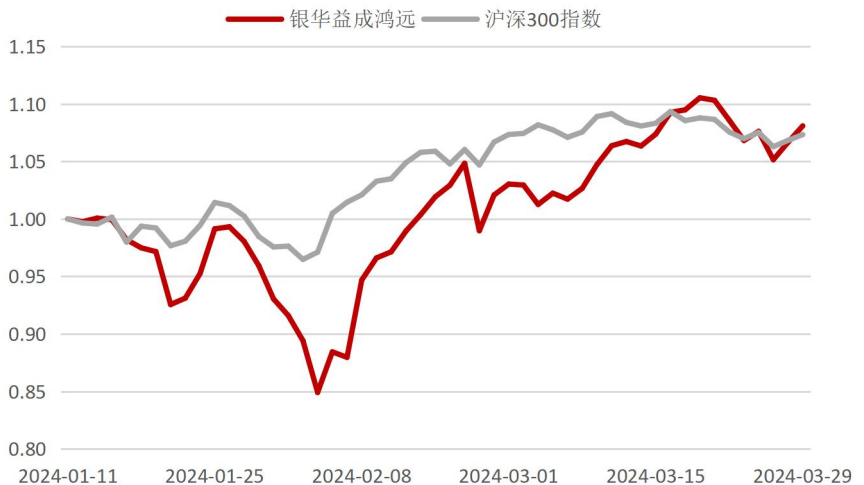
产品	起始日期	2024 年一季度		2024 年		2023 年		2022 年	
		收益	超额	收益	超额	收益	超额	收益	超额
银华益成大类资产	2022/1/19	4.45%	1.61%	4.45%	1.61%	8.06%	21.39%	-2.27%	19.51%
银华益成鸿远	2024/1/11	8.10%	0.94%	8.10%	0.94%	-	-	-	-

产品业绩展示

项目	银华益成 大类资产	沪深 300 指数	超额
绝对收益	10.30%	-26.00%	47.41%
年化收益	4.72%	-13.22%	20.04%
波动率	20.41%	17.18%	15.02%
夏普比率	0.23	-0.77	1.33
最大回撤	-28.20%	-35.64%	-16.69%
当前回撤	-5.72%	-26.66%	-0.91%



项目	银华益成 鸿远	沪深 300 指数	超额
绝对收益	8.10%	7.34%	0.94%
年化收益	46.47%	41.49%	4.69%
波动率	36.20%	16.65%	28.63%
夏普比率	1.28	2.49	0.16
最大回撤	-15.15%	-4.88%	-13.69%
当前回撤	-2.21%	-1.83%	-0.85%



备注：上述超额数据相关统计均根据产品与沪深 300 日度超额收益率序列计算得出