

# 银华量化益成系列产品季报

(2024/03/29—2024/06/28)

## 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	-0.83%	-2.14%	-6.50%	-10.02%	-13.75%	1.06%

## 产品表现

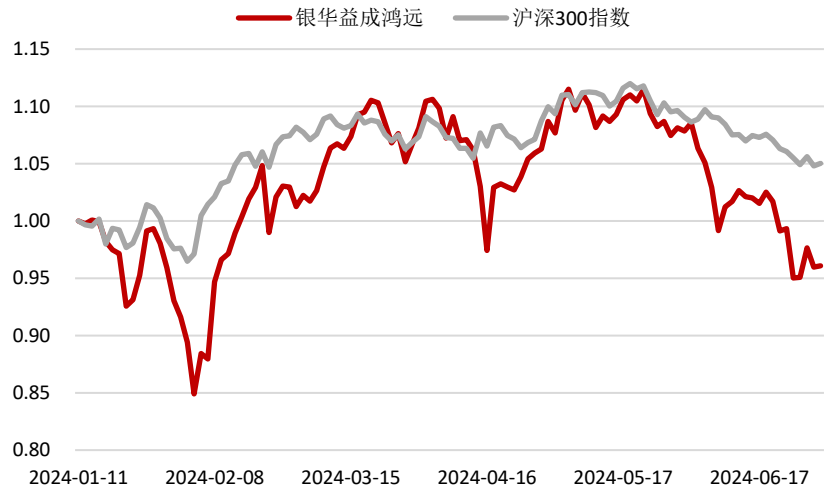
产品	起始日期	2024 年二季度		2024 年		2023 年		2022 年	
		收益	超额	收益	超额	收益	超额	收益	超额
银华益成大类资产	2022/1/19	-8.84%	-6.70%	-4.79%	-5.27%	8.06%	21.39%	-2.27%	19.51%
银华益成鸿远	2024/1/11	-11.10%	-8.96%	-3.90%	-8.25%	-	-	-	-

## 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	0.55%	-27.59%	37.43%
年化收益	0.23%	-12.78%	14.42%
波动率	21.34%	16.73%	16.21%
夏普比率	0.01	-0.76	0.89
最大回撤	-28.20%	-35.64%	-16.69%
当前回撤	-14.06%	-28.23%	-7.94%



项目	银华益成 鸿远	沪深 300 指数	超额
绝对收益	-3.90%	5.04%	-8.25%
年化收益	-8.65%	11.82%	-17.77%
波动率	32.32%	14.39%	26.62%
夏普比率	-0.27	0.82	-0.67
最大回撤	-15.15%	-6.42%	-13.69%
当前回撤	-13.82%	-6.21%	-10.09%



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