银华量化益成系列产品季报

（2025/12/31—2026/03/31）

市场情况

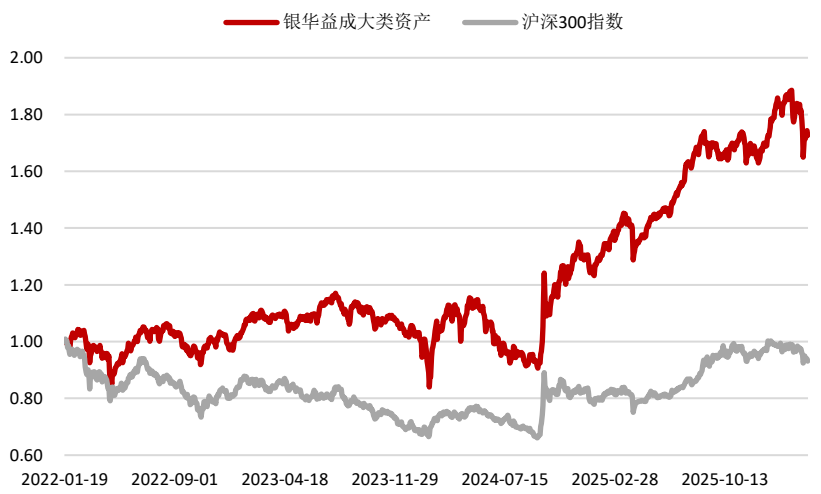
	上证 50	沪深 300	中证 500	中证 1000	中证 2000	红利指数
季度收益率	-6.76%	-3.89%	2.03%	0.32%	1.22%	6.68%

产品表现

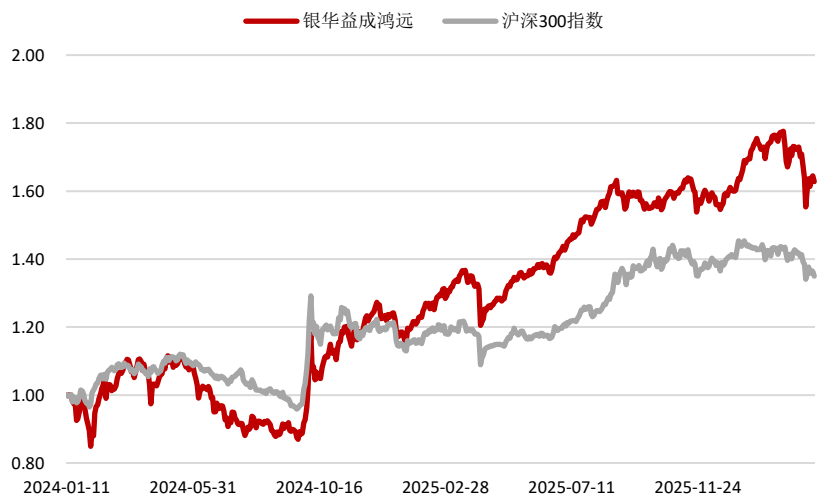
产品	起始日期	2026 一季度		2026 年		2025 年		2024 年		2023 年		2022 年	
		收益	超额	收益	超额	收益	超额	收益	超额	收益	超额	收益	超额
银华益成大类资产	2022/1/19	2.11%	6.00%	2.11%	6.00%	31.19%	10.88%	22.02%	7.13%	8.06%	21.39%	-2.27%	19.51%
银华益成鸿远	2024/1/11	1.57%	5.46%	1.57%	5.46%	31.20%	10.89%	22.15%	2.79%	-	-	-	-

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	72.62%	-6.91%	83.15%
年化收益	14.41%	-1.75%	16.09%
波动率	22.03%	17.78%	15.21%
夏普比率	0.65	-0.10	1.06
最大回撤	-28.20%	-36.05%	-16.69%
当前回撤	-8.45%	-7.74%	-5.51%



项目	银华益成鸿远	沪深 300 指数	超额
绝对收益	62.79%	35.03%	20.51%
年化收益	25.62%	15.10%	9.13%
波动率	24.88%	18.23%	17.14%
夏普比率	1.03	0.83	0.53
最大回撤	-22.05%	-15.66%	-16.46%
当前回撤	-8.34%	-7.11%	-4.30%



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