

基金周报

首批北交所定开基金迎来首个开放期，中基协修订发布自律规则

核心观点

上周市场回顾。上周A股市场主要宽基指数全线下跌，上证综指、沪深300、中证500收益靠前，收益分别为-0.44%、-0.84%、-1.08%，科创50、创业板指、中小板指收益靠后，收益分别为-2.98%、-2.45%、-1.94%。从成交额来看，上周主要宽基指数成交额均有所减少。行业方面，上周房地产、农林牧渔、煤炭收益靠前，收益分别为3.94%、3.46%、2.35%，计算机、通信、电子收益靠后，收益分别为-4.17%、-3.90%、-3.34%。

截至上周五，央行逆回购净投放资金4060亿元，逆回购到期17610亿元，净公开市场投放21670亿元。不同期限的国债利率有所上行，利差缩窄15.67BP。上周中证转债指数下跌1.04%，累计成交1978亿元，较前一周减少168亿元。

上周共上报28只基金，较上上周申报数量有所减少。申报的产品包括3只QDII，1只FOF，嘉实中证全指储能设备ETF、富国恒生沪深港航运主题ETF等。

11月23日，富达基金发布公告称，富达裕达纯债自11月1日至11月21日发行，认购金额合计超50亿元，由成皓担任基金经理。

11月24日，首批深证50ETF结束募集，分别为富国深证50ETF和易方达深证50ETF，两只基金均于11月20日开始发行，11月24日结束募集。

开放式公募基金表现。上周主动权益、灵活配置型、平衡混合型基金收益分别为-1.01%、-0.75%、-0.30%。今年以来另类基金业绩表现最优，中位数收益为10.60%，主动权益型、灵活配置型和平衡混合型基金的中位数收益分别为-11.35%、-7.42%、-4.25%。

上周指数增强基金超额收益中位数为0.24%，量化对冲型基金收益中位数为-0.03%。今年以来，指数增强基金超额中位数为1.21%，量化对冲型基金收益中位数为0.56%。

截至上周末，开放式公募基金中共有普通FOF基金216只、目标日期基金118只、目标风险基金143只。今年以来，目标风险基金中位数业绩表现最优，累计收益率为-1.90%。

基金产品发行情况。上周新成立基金33只（含1只转型基金），合计发行规模为392.60亿元，较前一周有所增加。此外，上周有30只基金首次进入发行阶段，本周将有26只基金开始发行。

风险提示：市场环境变动风险，风格切换风险。

金融工程周报

金融工程·量化投资

证券分析师：张欣慰 联系人：陈梦琪
021-60933159 021-60375447
zhangxinwei1@guosen.com.cn chenmengqi@guosen.com.cn
S0980520060001

相关研究报告

《多因子选股周报-波动率因子表现出色，三大指增组合本周均跑赢基准》——2023-11-25
《港股投资周报-港股精选组合本周相对恒生指数超额收益0.49%》——2023-11-25
《主动量化策略周报-四大主动量化组合本周均战胜股基指数》——2023-11-25
《热点追踪周报-由创新高个股看市场投资热点（第122期）》——2023-11-24
《私募基金周报-上周沪深300指增私募超额中位数0.78%，百亿私募调研聚焦机械、电子板块》——2023-11-23

内容目录

上周市场回顾	4
相关热点回顾	4
股票市场	5
债券市场	8
可转债市场	9
开放式公募基金表现	10
普通公募基金	10
量化公募基金	10
FOF 基金	11
基金经理变更	12
基金产品发行情况	12
上周新成立基金	12
上周首发基金	14
本周待发行基金	15
附：开放式公募基金前 N 名业绩明细	17

图表目录

图 1: 主要宽指数收益率 (截至 2023.11.24)	5
图 2: 上周宽基指数成交额 (千亿) 及过去 52 周分位数 (截至 2023.11.24)	6
图 3: 过去 1 个月指数日均成交额 (千亿) 及过去 36 个月分位数 (截至 2023.11.24)	7
图 4: 中信一级行业指数收益 (截至 2023.11.24)	8
图 5: 债券利率 (截至 2023.11.24)	9
图 6: 债券利率周度变动 (BP, 截至 2023.11.24)	9
图 7: 中证转债走势及成交额 (截至 2023.11.24)	9
图 8: 转股溢价率中位数和纯债溢价率中位数	9
图 9: 不同类别基金上周收益表现 (截至 2023.11.24)	10
图 10: 不同类别基金本年收益表现 (截至 2023.11.24)	10
图 11: 指数增强基金超额收益及量化对冲基金收益表现 (截至 2023.11.24)	11
图 12: 不同类别 FOF 权益占比 (截至 2023.11.24)	11
图 13: 不同类别 FOF 基金收益中位数 (截至 2023.11.24)	11
图 14: 不同类别基金周度新发规模 (亿元)	13
表 1: 上周公募基金申报情况 (2023.11.20 至 2023.11.24)	4
表 2: 首批北交所定开基金	5
表 3: 货币市场利率 (截至 2023.11.24)	8
表 4: 信用债利差及周度利差变动 (BP, 截至 2023.11.24)	9
表 5: 上周基金经理变更明细	12
表 6: 上周新成立基金统计 (仅展示初始份额)	14
表 7: 上周首发基金列表 (仅展示初始份额, 亿份)	15
表 8: 本周待发行基金列表 (仅展示初始份额)	16
表 9: 周度业绩前三的普通公募基金 (截至 2023.11.24)	17
表 10: 周度超额业绩前十的指数增强基金 (截至 2023.11.24)	17
表 11: 周度业绩前十的量化对冲基金 (截至 2023.11.24)	18
表 12: 年度业绩前三的普通公募基金 (截至 2023.11.24)	18
表 13: 年度超额业绩前十的指数增强基金 (截至 2023.11.24)	19
表 14: 年度业绩前十的量化对冲基金 (截至 2023.11.24)	19

上周市场回顾

相关热点回顾

一、基金申报发行动态

上周共上报 28 只基金，较上上周申报数量有所减少。申报的产品包括 3 只 QDII，1 只 FOF，嘉实中证全指储能设备 ETF、富国恒生沪深港航运主题 ETF 等。

表1: 上周公募基金申报情况 (2023.11.20 至 2023.11.24)

基金类型	指数型				债券型		QDII	FOF	混合型	股票型
	股票指数	债券指数	ETF	联接	其他债券	定开债				
数量	4	2	2	1	10	1	3	1	3	1

资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

1、富达基金首只固收产品募资超 50 亿元

11 月 23 日，富达基金发布公告称，富达裕达纯债自 11 月 1 日至 11 月 21 日发行，认购金额合计超 50 亿元，由成皓担任基金经理。

2、首批深证 50ETF 发行

11 月 24 日，首批深证 50ETF 结束募集，分别为富国深证 50ETF 和易方达深证 50ETF，两只基金均于 11 月 20 日开始发行，11 月 24 日结束募集。该 ETF 跟踪的是深证 50 指数，指数反映了深市市值规模大、行业代表性强、公司治理良好的 50 家公司股价变化情况。

二、基金业协会修订基金从业人员有关自律规则

11 月 24 日，为贯彻落实中央金融工作会议部署，全面加强金融监管，进一步规范基金从业人员执业行为，提高基金从业人员特别是基金经理、投资经理等投资管理人的合规意识和职业操守，在证监会指导下，中国证券投资基金业协会（以下简称协会）修订发布《基金从业人员管理规则》及配套规则和《证券期货经营机构投资管理人员注册登记规则》。

本次修订践行“诚实守信、以义取利、稳健审慎、守正创新、依法合规”的要求，旨在推动建立职业道德水平高、专业能力强的基金从业人员队伍，为保护投资者合法权益、促进基金行业高质量发展、加快建设中国特色现代金融体系、坚定不移走好中国特色金融发展之路提供人才保障。

三、首批北交所定开基金迎来首个开放期

11 月 23 日，首批 8 只北交所定开基金在运作两年后集体迎来首个开放期。如表 2 所示，8 只北交所主题定开基金成立于 2021 年 11 月 23 日，均采用两年定期开放的形式运作。近期北交所股票持续受到投资者关注，上周北证 50 指数上涨 20.96%，8 只北交所主题基金上周表现也十分良好，涨幅均超 7%。

表2: 首批北交所定开基金

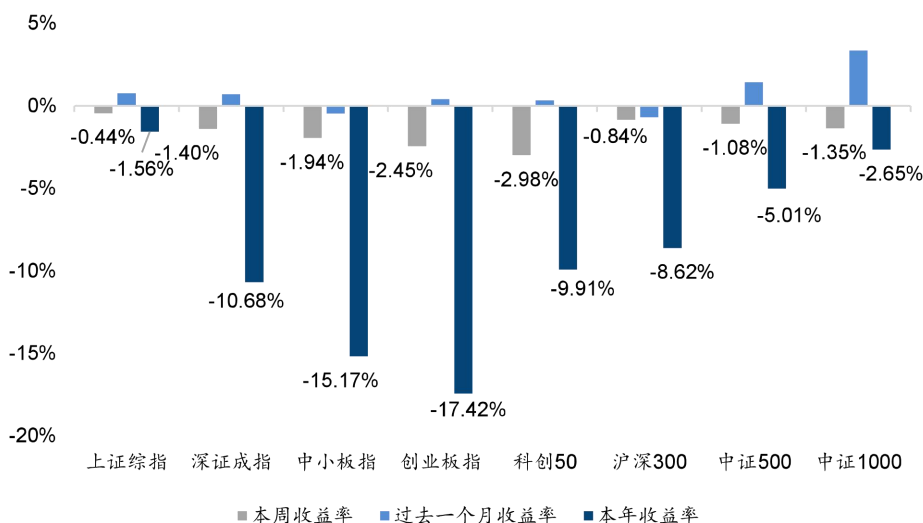
基金代码	基金简称	基金类型	基金成立日	基金规模, 亿元, 20230930	成立以来收益, 截至 20231124	上周收益
014273.OF	广发北交所精选两年定开 A	偏股混合型基金	20211123	4.29	-5.20%	13.69%
014294.OF	南方北交所精选两年定开	偏股混合型基金	20211123	4.06	-8.04%	10.81%
014283.OF	华夏北交所创新中小企业精选两年定开	偏股混合型基金	20211123	4.04	-10.20%	10.73%
014275.OF	易方达北交所精选两年定开 A	偏股混合型基金	20211123	4.00	-10.71%	10.69%
014277.OF	万家北交所慧选两年定开 A	偏股混合型基金	20211123	3.98	-13.23%	9.79%
014279.OF	汇添富北交所创新精选两年定开 A	偏股混合型基金	20211123	3.55	-16.75%	9.02%
014271.OF	大成北交所两年定开 A	偏股混合型基金	20211123	3.50	-25.81%	8.22%
014269.OF	嘉实北交所精选两年定开 A	偏股混合型基金	20211123	3.01	-35.31%	7.93%

资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

股票市场

上周 A 股市场主要宽基指数全线下跌, 上证综指、沪深 300、中证 500 收益靠前, 收益分别为-0.44%、-0.84%、-1.08%, 科创 50、创业板指、中小板指收益靠后, 收益分别为-2.98%、-2.45%、-1.94%。过去一个月中证 1000 指数上涨 3.36%, 收益最高, 沪深 300 指数下跌 0.68%, 收益最低。年初至今, 主要宽基指数中上证综指收益最高, 其累计收益率为-1.56%。

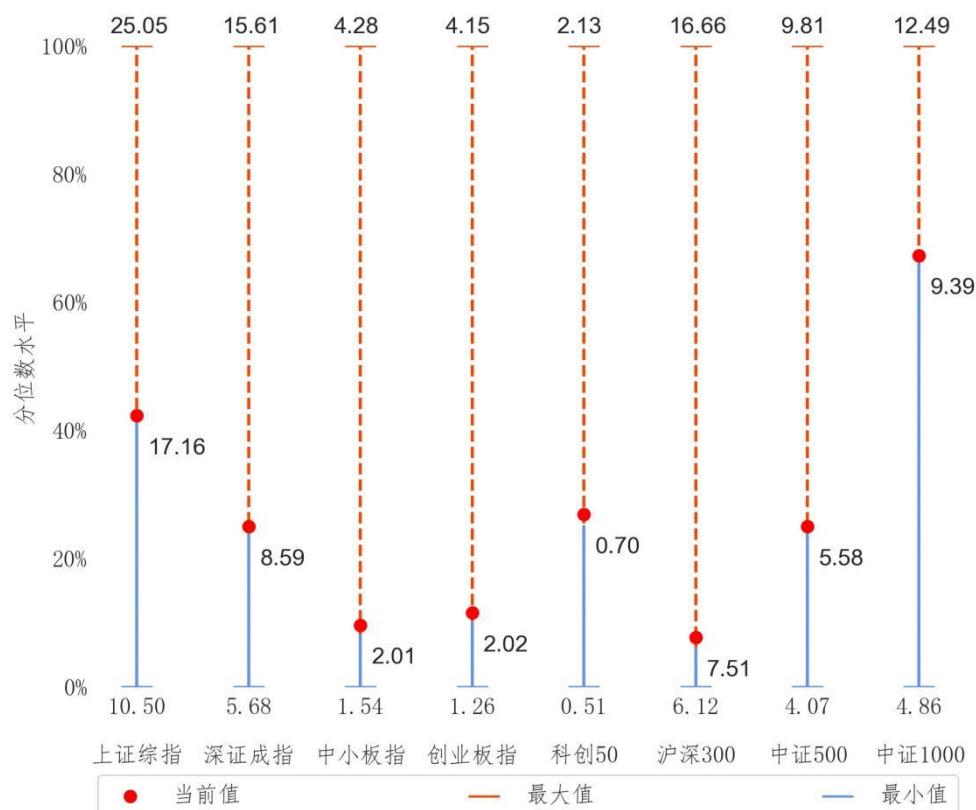
图1: 主要宽指数收益率 (截至 2023.11.24)



资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

从成交额来看, 上周主要宽基指数成交额均有所减少, 在过去 52 周的样本期内, 主要宽基指数均位于 5%-70%的历史分位水平。

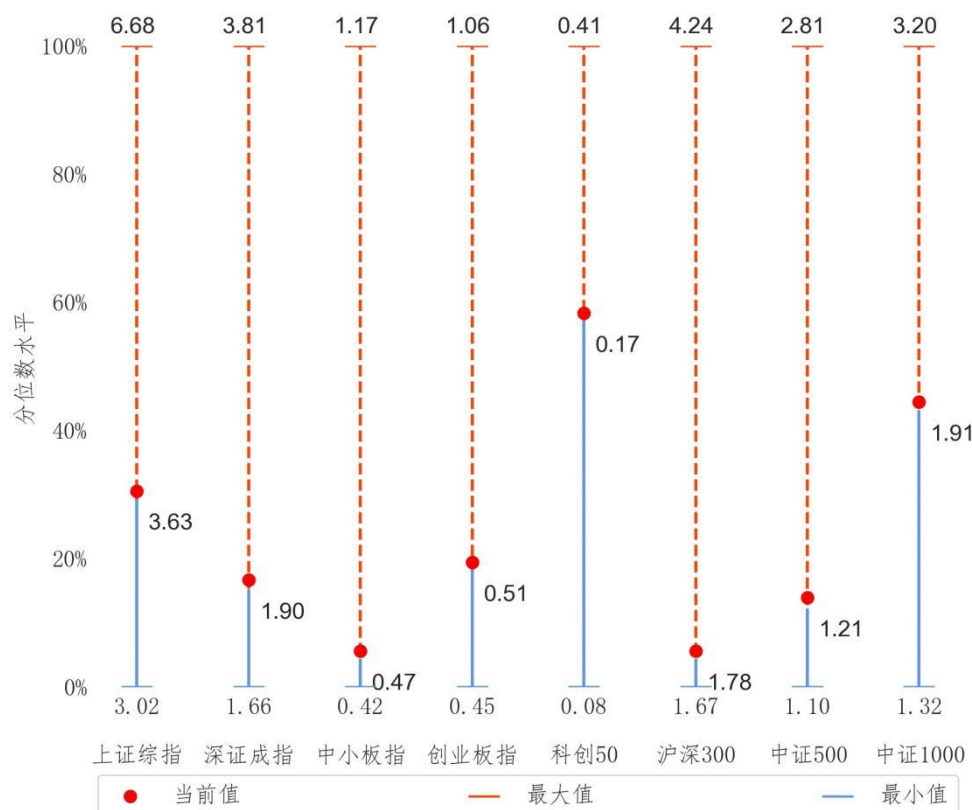
图2：上周宽基指数成交额（千亿）及过去 52 周分位数（截至 2023.11.24）



资料来源：Wind、国信证券经济研究所整理

按月度来看，除上证综指、中证 1000 外，过去一个月主要宽基指数日均成交额有所减少，主要宽基指数均位于过去 36 个月 5%-60%的历史分位水平。

图3：过去 1 个月指数日均成交额（千亿）及过去 36 个月分位数（截至 2023.11.24）



资料来源：Wind、国信证券经济研究所整理

行业方面，上周房地产、农林牧渔、煤炭收益靠前，收益分别为 3.94%、3.46%、2.35%，计算机、通信、电子收益靠后，收益分别为-4.17%、-3.90%、-3.34%。过去一个月，传媒累计上涨 11.70%，收益最高，电力设备及新能源行业累计下跌 2.24%，收益最低。今年以来，传媒、通信、计算机的累计收益较高，分别为 27.15%、24.33%、12.91%，相比之下，消费者服务、电力设备及新能源、房地产等多个行业的收益率最低。

图4：中信一级行业指数收益（截至 2023.11.24）

行业	本周收益率	行业	过去一个月收益率	行业	本年收益率
房地产	3.94%	传媒	11.70%	传媒	27.15%
农林牧渔	3.46%	计算机	5.27%	通信	24.33%
煤炭	2.35%	综合	5.24%	计算机	12.91%
综合金融	1.71%	煤炭	5.18%	汽车	11.62%
医药	1.64%	医药	5.13%	煤炭	10.49%
商贸零售	1.55%	农林牧渔	4.69%	家电	10.37%
食品饮料	0.98%	房地产	4.48%	石油石化	9.57%
交通运输	0.94%	商贸零售	3.72%	电子	7.66%
综合	0.76%	电子	3.32%	非银行金融	6.37%
建材	0.50%	轻工制造	2.46%	纺织服装	4.90%
银行	0.39%	机械	2.40%	综合金融	2.14%
石油石化	0.31%	消费者服务	2.33%	银行	0.98%
消费者服务	0.09%	综合金融	2.28%	建筑	0.67%
钢铁	-0.08%	通信	2.21%	电力及公用事业	0.58%
纺织服装	-0.09%	食品饮料	2.20%	机械	0.12%
家电	-0.12%	国防军工	1.80%	钢铁	-1.87%
轻工制造	-0.17%	交通运输	0.95%	医药	-2.79%
建筑	-0.33%	基础化工	0.64%	轻工制造	-3.50%
电力及公用事业	-0.52%	纺织服装	0.56%	国防军工	-6.59%
传媒	-0.55%	汽车	0.55%	商贸零售	-6.97%
基础化工	-1.60%	电力及公用事业	0.19%	有色金属	-7.29%
非银行金融	-1.62%	钢铁	0.02%	食品饮料	-8.10%
机械	-1.90%	建筑	-0.35%	交通运输	-10.76%
有色金属	-2.19%	非银行金融	-0.90%	农林牧渔	-10.80%
汽车	-2.21%	家电	-1.12%	综合	-11.85%
国防军工	-2.31%	建材	-1.41%	基础化工	-14.81%
电力设备及新能源	-2.93%	石油石化	-1.58%	建材	-15.21%
电子	-3.34%	银行	-1.94%	房地产	-15.25%
通信	-3.90%	有色金属	-1.98%	电力设备及新能源	-23.47%
计算机	-4.17%	电力设备及新能源	-2.24%	消费者服务	-38.08%

资料来源：Wind、国信证券经济研究所整理

债券市场

截至上周五，央行逆回购净投放资金 4060 亿元，逆回购到期 17610 亿元，净公开市场投放 21670 亿元。质押式回购利率：7D 相比前一周增加 68.85BP，SHIBOR：2W 相比前一周增加 29.23BP。

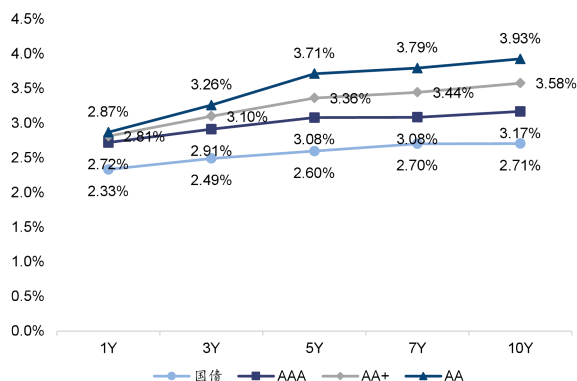
表3：货币市场利率（截至 2023.11.24）

	质押式回购				SHIBOR			
	1D	7D	14D	1M	隔夜	1W	2W	1M
上周末%	1.94	2.94	2.77	2.56	1.84	2.20	2.67	2.24
周度变动 BP	-7.00	68.85	21.70	12.83	-4.52	23.28	29.23	0.60

资料来源：Wind、国信证券经济研究所整理

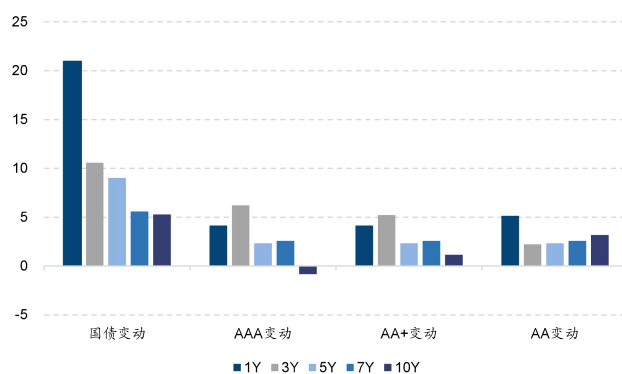
如下图所示，不同期限的国债利率有所上行，利差缩窄 15.67BP，1 年期、3 年期、5 年期、7 年期的不同评级的信用债利率均有所上行。

图5: 债券利率 (截至 2023.11.24)



资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

图6: 债券利率周度变动 (BP, 截至 2023.11.24)



资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

信用利差方面, 不同期限的信用债利差均有所下行。

表4: 信用债利差及周度利差变动 (BP, 截至 2023.11.24)

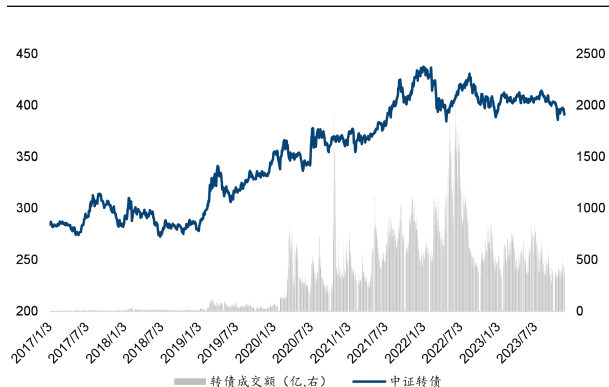
债券期限	AAA	AAA 利差变动	AA+	AA+利差变动	AA	AA 利差变动
1Y	38.83	-16.81	48.11	-16.81	53.61	-15.81
3Y	42.07	-4.37	60.89	-5.37	76.89	-8.37
5Y	48.39	-6.69	76.70	-6.69	111.70	-6.69
7Y	38.12	-3.03	74.13	-3.03	109.13	-3.03
10Y	46.26	-6.12	87.23	-4.12	122.23	-2.12

资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

可转债市场

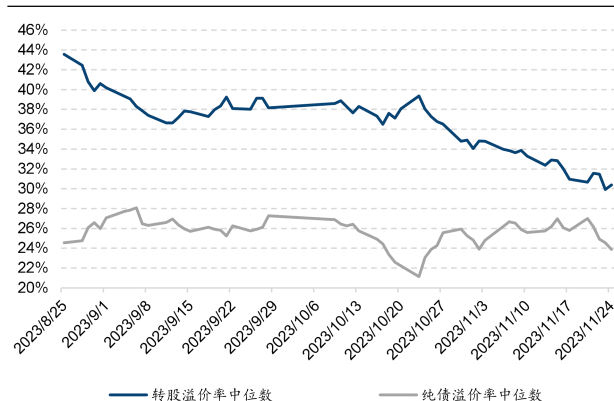
上周中证转债指数下跌 1.04%, 累计成交 1978 亿元, 较前一周减少 168 亿元。截至上周五, 可转债市场转股溢价率中位数为 30.38%, 较前一周减少 0.58%, 纯债溢价率中位数为 23.89%, 较前一周减少 1.91%。

图7: 中证转债走势及成交额 (截至 2023.11.24)



资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

图8: 转股溢价率中位数和纯债溢价率中位数



资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

开放式公募基金表现

普通公募基金

统计普通公募基金的业绩表现（不含指数增强基金、指数基金、FOF基金），新成立基金在6个月建仓期满之后才参与统计，并以开放式基金中的普通股票型基金和偏股混合型基金作为主动权益基金的样本池。上周主动权益、灵活配置型、平衡混合型基金收益分别为-1.01%、-0.75%、-0.30%。

图9：不同类别基金上周收益表现（截至2023.11.24）

分组	主动权益	灵活配置型	平衡混合型	偏债混合型	短期纯债	中长期纯债	混合债一级	混合债二级	货币型	另类
Min	-9.04%	-7.53%	-1.47%	-2.84%	-0.20%	-0.50%	-1.87%	-2.95%	0.01%	-4.22%
10%	-3.31%	-3.26%	-1.20%	-0.76%	-0.05%	-0.17%	-0.39%	-0.84%	0.02%	-1.54%
20%	-2.47%	-2.32%	-0.84%	-0.50%	-0.02%	-0.13%	-0.25%	-0.53%	0.02%	-1.48%
30%	-1.91%	-1.70%	-0.51%	-0.38%	0.00%	-0.10%	-0.16%	-0.41%	0.02%	-1.42%
40%	-1.42%	-1.20%	-0.39%	-0.30%	0.00%	-0.07%	-0.13%	-0.33%	0.02%	-1.41%
50%	-1.01%	-0.75%	-0.30%	-0.23%	0.01%	-0.05%	-0.09%	-0.26%	0.03%	-1.38%
60%	-0.70%	-0.42%	-0.17%	-0.18%	0.02%	-0.03%	-0.05%	-0.18%	0.03%	-0.55%
70%	-0.31%	-0.20%	-0.11%	-0.11%	0.03%	-0.01%	-0.02%	-0.12%	0.03%	-0.14%
80%	0.10%	-0.01%	0.29%	-0.06%	0.03%	0.02%	0.00%	-0.06%	0.03%	-0.03%
90%	0.64%	0.32%	0.52%	0.04%	0.05%	0.06%	0.04%	0.02%	0.03%	0.11%
Max	15.69%	4.85%	0.84%	1.35%	0.20%	3.61%	1.02%	1.27%	0.09%	0.50%

资料来源：Wind、国信证券经济研究所整理

今年以来另类基金业绩表现最优，中位数收益为10.60%，主动权益型、灵活配置型和平衡混合型基金的中位数收益分别为-11.35%、-7.42%、-4.25%。

图10：不同类别基金本年收益表现（截至2023.11.24）

分组	主动权益	灵活配置型	平衡混合型	偏债混合型	短期纯债	中长期纯债	混合债一级	混合债二级	货币型	另类
Min	-46.07%	-45.89%	-20.21%	-17.88%	0.40%	-1.51%	-6.57%	-11.26%	0.96%	-12.40%
10%	-21.58%	-20.18%	-11.48%	-4.57%	1.83%	1.99%	1.32%	-2.62%	1.30%	-4.97%
20%	-17.91%	-15.90%	-10.77%	-2.80%	2.23%	2.19%	2.03%	-1.53%	1.52%	-0.97%
30%	-15.42%	-12.66%	-9.66%	-1.84%	2.47%	2.37%	2.44%	-0.72%	1.59%	0.98%
40%	-13.42%	-10.29%	-5.00%	-1.11%	2.71%	2.62%	2.77%	-0.01%	1.64%	2.82%
50%	-11.35%	-7.42%	-4.25%	-0.31%	2.84%	2.89%	3.05%	0.54%	1.68%	10.60%
60%	-9.30%	-4.44%	-3.69%	0.28%	3.07%	3.20%	3.36%	1.24%	1.73%	11.22%
70%	-7.02%	-2.22%	-2.59%	0.93%	3.27%	3.57%	3.73%	1.74%	1.76%	12.00%
80%	-3.92%	0.04%	-2.24%	1.71%	3.53%	3.99%	4.27%	2.47%	1.81%	12.32%
90%	0.07%	2.59%	0.56%	2.69%	3.81%	4.68%	5.11%	3.27%	1.91%	12.66%
Max	36.92%	48.36%	2.92%	13.75%	5.86%	11.26%	12.00%	7.59%	2.23%	14.39%

资料来源：Wind、国信证券经济研究所整理

量化公募基金

统计指数增强基金相对基准的超额收益和量化对冲型基金的收益情况，新成立基金在6个月建仓期满之后才参与统计。上周指数增强基金超额收益中位数为0.24%，量化对冲型基金收益中位数为-0.03%。今年以来，指数增强基金超额中位数为1.21%，量化对冲型基金收益中位数为0.56%。

图11: 指数增强基金超额收益及量化对冲基金收益表现 (截至 2023.11.24)

分组	指数增强型基金本周超额收益	量化对冲型基金本周收益	指数增强型基金本年超额收益	量化对冲型基金本年收益
Min	-1.10%	-0.42%	-8.19%	-7.10%
10%	-0.13%	-0.31%	-3.37%	-5.66%
20%	-0.01%	-0.16%	-1.57%	-3.38%
30%	0.09%	-0.11%	-0.47%	-1.55%
40%	0.18%	-0.08%	0.55%	-0.53%
50%	0.24%	-0.03%	1.21%	0.56%
60%	0.34%	0.04%	2.01%	0.96%
70%	0.43%	0.07%	2.98%	1.75%
80%	0.56%	0.17%	4.04%	2.20%
90%	0.72%	0.26%	5.77%	4.63%
Max	2.09%	0.50%	12.03%	10.77%

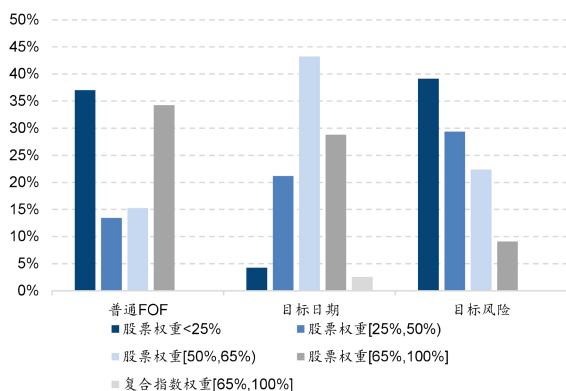
资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

FOF 基金

截至上周末, 开放式公募基金中共有普通 FOF 基金 216 只、目标日期基金 118 只、目标风险基金 143 只。¹ 上周新成立 1 只 FOF 基金, 分别为长城精选进取 3 个月持有 A。依据业绩比较基准计算 FOF 基金中权益类资产的权重, 并将基金类指数按照预计权益占比²进行折算。总的来看, 目标日期基金的权益仓位更高, 其权益仓位主要分布在 50%-65% 的区间内, 绝大多数目标风险基金权益仓位在 50% 以下, 普通 FOF 基金的权益仓位主要分布在 25% 以下和 65%-100% 的区间内。

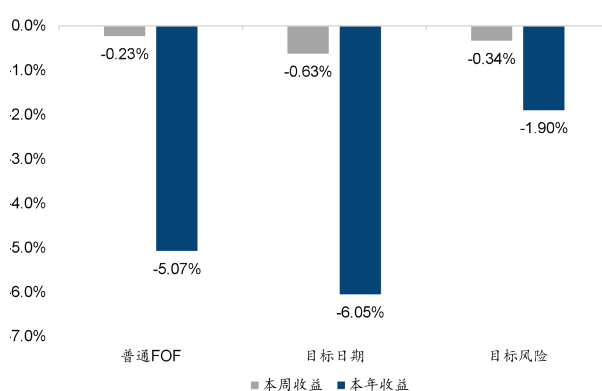
统计 FOF 基金的业绩表现 (新成立基金在 3 个月建仓期满之后才参与统计), 上周普通 FOF、目标日期、目标风险类基金收益中位数分别为 -0.23%、-0.63%、-0.34%。今年以来, 目标风险基金中位数业绩表现最优, 累计收益率为 -1.90%。

图12: 不同类别 FOF 权益占比 (截至 2023.11.24)



资料来源: Wind³、国信证券经济研究所整理

图13: 不同类别 FOF 基金收益中位数 (截至 2023.11.24)



资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

¹ 该分类参考 wind 的 FOF 基金分类进行划分, 并依据基金招募说明书中的相关信息进行调整。

² 预计权益占比: 将股票型基金指数权重的 85%、偏股型基金指数权重的 80%、债券型基金指数权重的 10%、开放式基金指数权重的 50%、中证工银财富股票混合基金指数权重的 80%、中证工银财富动态配置基金指数权重的 20% 划归为权益。

³ 本图中的复合指数是指中证南方养老目标日期、中证平安退休宝等指数, 由于此类指数的权益占比会随着时间的变动, 因而作为一个单独的分类进行统计。

基金经理变更

上周共有 34 家基金公司的 68 只基金产品其基金经理情况发生变动，其中产品变动数量较多的基金管理人招商基金（6 只）、汇添富基金（6 只）、新华基金（4 只）。

表5: 上周基金经理变更明细

基金代码	基金简称	新任基金经理	起始任职日期	离任基金经理	离任日期	基金代码	基金简称	新任基金经理	起始任职日期	离任基金经理	离任日期
009899.OF	上银内需增长 A	黄璜	20231123	-	-	005648.OF	招商添琪 3 个月定开 A	-	-	李家辉	20231123
014352.OF	东方创新成长 A	陈皓	20231120	蒋茜	20231120	008463.OF	招商添瑞 1 年定开债 A	-	-	李家辉	20231123
008428.OF	东方红鑫裕两年定开	高德勇	20231125	-	-	012196.OF	招商品质生活 A	-	-	王景	20231124
009670.OF	东方红益丰纯债 A	高德勇	20231125	-	-	008944.OF	摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 联接 A	韩秀一	20231123	胡迪	20231123
002881.OF	中加丰润纯债 A	张楠	20231124	-	-	515770.SH	摩根 MSCIAETF	韩秀一	20231123	胡迪	20231123
005879.OF	中加颐兴定期开放	袁素	20231124	-	-	000584.OF	新华鑫益 C	赖庆鑫	20231123	-	-
006453.OF	中加瑞利纯债 A	张楠	20231124	-	-	009885.OF	新华景气行业 A	王永明	20231123	-	-
008785.OF	中加博裕纯债	于跃	20231124	-	-	519089.OF	新华优选成长	赖庆鑫	20231123	-	-
508096.SH	中航京能光伏 REIT	张凯	20231121	侯明博	20231123	519091.OF	新华泛资源优势	赖庆鑫	20231123	-	-
002261.OF	中银宝利 A	-	-	宋殿宇	20231122	110037.OF	易方达纯债 A	李冠霖	20231121	张雅君	20231121
012379.OF	创金合信港股互联网 3 个月持有 A	孙悦	20231124	胡尧盛	20231124	003603.OF	景顺长城泰安 A	-	-	陈莹	20231123
018155.OF	创金合信全球医药生物 A	毛丁丁	20231124	-	-	018491.OF	格林聚合增强 A	冯翰尊	20231121	-	-
016687.OF	创金合信可转债长三角中高等级信用债 A	-	-	谢创	20231124	001417.OF	汇添富医疗服务 A	张韡	20231123	刘江	20231123
159853.SZ	科技 100ETF	-	-	龚涛	20231124	004877.OF	汇添富全球医疗人民币	张韡	20231123	刘江	20231123
050027.OF	博时信用债纯债 A	李禹成	20231124	-	-	010481.OF	汇添富高质量成长精选 2 年持有	-	-	刘江	20231123
014292.OF	嘉实产业领先 A	刘畅	20231121	-	-	010599.OF	汇添富高质量成长 30A	-	-	刘江	20231123
006803.OF	嘉实互通精选	-	-	郑伟彬	20231124	012155.OF	汇添富成长先锋六个月持有 A	-	-	刘江	20231123
010834.OF	国泰同益 18 个月持有 A	刘嵩扬	20231123	樊利安	20231123	501188.SH	添富核心精选 LOF	-	-	刘江	20231123
168207.SZ	创业定开	杜超	20231122	甘传琦	20231122	004513.OF	海富通沪深 300 指数增强 A	林立禾	20231123	-	-
004694.OF	天弘策略精选 A	胡东	20231124	-	-	010850.OF	海富通富利三个月持有 A	林立禾	20231123	-	-
350009.OF	天治研究驱动 A	梁莉	20231123	-	-	519222.OF	海富通欣益 A	林立禾	20231123	-	-
001651.OF	工银新蓝筹 A	-	-	王筱苓	20231123	519007.OF	海富通强化回报	-	-	方昆明	20231123
010744.OF	工银灵动价值 A	-	-	王筱苓	20231123	010102.OF	西部利得鑫泓增强 A	何奇	20231123	梁晓明	20231123
481008.OF	工银大盘蓝筹	-	-	王筱苓	20231123	010102.OF	西部利得鑫泓增强 A	-	-	周平	20231123
481013.OF	工银消费服务 A	-	-	王筱苓	20231123	010440.OF	诺德安鸿纯债	-	-	景辉	20231124
013765.OF	平安恒泰 1 年持有 A	-	-	周思源	20231123	011094.OF	诺德安盛	-	-	景辉	20231124
016628.OF	广发添财 60 天持有 A	宋倩倩	20231124	-	-	016727.OF	鑫元嘉利一年定开	郭卉	20231123	-	-
530019.OF	建信社会责任	李登虎	20231122	-	-	009977.OF	银华招利一年持有期 A	-	-	李丹	20231122
001367.OF	德邦新添利 A	李荣兴	20231120	汪晖	20231120	018568.OF	长信稳固 60 天滚动持有 A	邹依恩	20231120	-	-
001412.OF	德邦鑫星价值 A	-	-	吴志鹏	20231120	018568.OF	长信稳固 60 天滚动持有 A	朱黎明	20231120	-	-
008838.OF	德邦量化对冲策略 A	-	-	吴志鹏	20231120	018744.OF	长信 90 天持有 A	朱黎明	20231120	-	-
167702.OF	德邦量化优选 A	-	-	吴志鹏	20231120	011899.OF	长安鑫瑞科技先锋 6 个月定开 A	肖洁	20231124	江山	20231124
014456.OF	招商稳恒中短债 60 天持有 A	李家辉	20231123	-	-	740001.OF	长安宏观策略 A	肖洁	20231124	江山	20231124
000792.OF	招商定期宝六个月	张宜杰	20231124	许强	20231124	009958.OF	长安鑫悦消费驱动 A	-	-	徐小勇	20231124
011690.OF	招商品质发现 A	苏超	20231125	-	-	013353.OF	鹏华上华一年持有 A	罗政	20231124	-	-

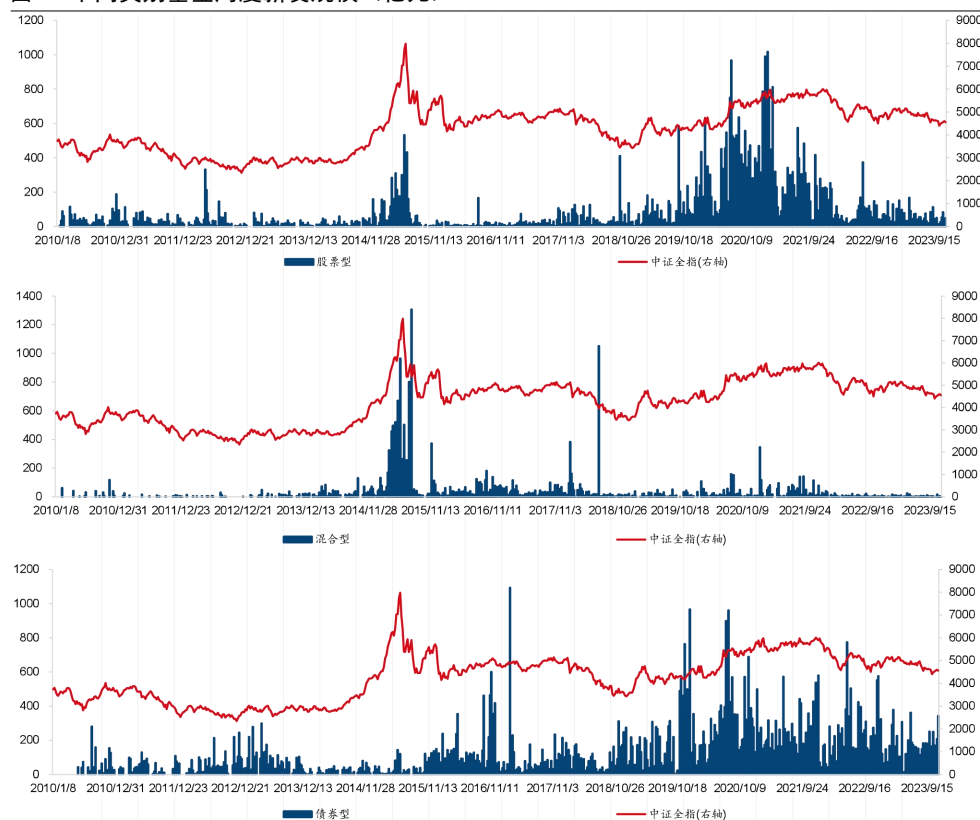
资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

基金产品发行情况

上周新成立基金

上周新发基金合计发行规模为 392.60 亿元，较前一周有所增加。其中股票型基金发行 49.17 亿元、混合型基金发行 0.12 亿元、债券型基金发行 343.32 亿元，另类基金和货币基金无新发。

图14: 不同类别基金周度新发规模 (亿元)



资料来源: Wind、国信证券经济研究所整理

上周新成立基金 33 只 (含 1 只转型基金), 新发基金中数量较多的类型为被动指数型 (12 只) 和中长期纯债型 (8 只), 发行规模分别为 32.62 亿元和 272.01 亿元。

表6: 上周新成立基金统计 (仅展示初始份额)

投资类型	基金代码	基金名称	基金成立日	发行份额, 亿, 不同份额合并	基金管理人	基金经理
被动指数型债券	019841.OF	恒生前海中债 0-3 年政策性金融债 A	2023-11-22	50.69	恒生前海基金	李维康
被动指数型债券	019443.OF	浙商汇金同业存单指数 7 天持有	2023-11-21	17.20	浙商资管	程嘉伟
被动指数型	513630.OF	摩根标普港股通低波红利 ETF	2023-11-23	13.63	摩根基金	胡迪,何智豪
被动指数型	510980.OF	汇添富上证综合 ETF	2023-11-22	4.65	汇添富基金	吴振翔
被动指数型	561010.OF	华安中证全指软件开发 ETF	2023-11-21	3.43	华安基金	苏卿云
被动指数型	159549.OF	天弘中证红利低波动 100ETF	2023-11-23	2.71	天弘基金	刘笑明
被动指数型	159505.OF	博时国证 2000ETF	2023-11-23	2.32	博时基金	唐屹兵
被动指数型	159661.OF	嘉实中证 100ETF	2023-11-23	2.19	嘉实基金	李直
被动指数型	562600.OF	华夏中证全指医疗器械 ETF	2023-11-23	2.08	华夏基金	华龙
被动指数型	019866.OF	国泰上证科创板 100 联接 A	2023-11-21	1.11	国泰基金	麻绎文
被动指数型	019311.OF	南方富时中国国企开放共赢联接 A	2023-11-21	0.14	南方基金	龚涛
被动指数型	019886.OF	南方国证交通运输行业联接 A	2023-11-24	0.14	南方基金	崔蕾
被动指数型	019162.OF	汇添富中证 800 价值联接 A	2023-11-21	0.11	汇添富基金	晏阳
被动指数型	019428.OF	广发中证国新央企股东回报联接 A	2023-11-24	0.11	广发基金	罗国庆
混合型 FOF	019678.OF	长城精选进取 3 个月持有 A	2023-11-20	0.12	长城基金	应俊帅
混合债券型二级	018884.OF	建信开元惠享 6 个月持有 A	2023-11-21	0.61	建信基金	徐文琪,王琦
混合债券型一级	018170.OF	嘉实双季瑞享 6 个月持有 A	2023-11-23	2.81	嘉实基金	李卓锴,李宇昂
混合债券型一级	970213.OF	中信建投悦享 6 个月持有 A	2023-11-22	转型	中信建投证券	欧阳政
普通股票型	019759.OF	中欧半导体产业 A	2023-11-21	0.10	中欧基金	钱亚婷
增强指数型	014623.OF	中银 MSCI 中国 A50 互联互通指数增强 A	2023-11-22	2.21	中银基金	赵志华
国际(QDII)股票型	513350.OF	油气 ETF	2023-11-20	2.15	富国基金	田希蒙
偏股混合型	019470.OF	华夏信兴回报 A	2023-11-21	6.17	华夏基金	王君正
偏股混合型	019379.OF	南方前瞻共赢三年定开	2023-11-23	2.77	南方基金	张延阁
偏股混合型	019982.OF	泓德智选启元 A	2023-11-21	2.66	泓德基金	苏昌景
偏股混合型	019374.OF	广发睿杰精选 A1	2023-11-24	0.49	广发基金	蒋科
中长期纯债型	019724.OF	鑫元稳丰利率债	2023-11-23	79.90	鑫元基金	刘丽娟
中长期纯债型	019885.OF	南方恩元	2023-11-24	77.10	南方基金	黄河
中长期纯债型	019406.OF	富达裕达纯债 A	2023-11-22	50.00	富达基金	成皓
中长期纯债型	019585.OF	博远增裕利率债 A	2023-11-24	46.30	博远基金	钟鸣远,黄婧丽
中长期纯债型	020050.OF	英大安华纯债 A	2023-11-23	10.00	英大基金	吕一楠
中长期纯债型	019809.OF	华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有 A	2023-11-21	6.59	华泰柏瑞基金	郑青
中长期纯债型	018739.OF	国投瑞银恒源 30 天持有 A	2023-11-22	2.01	国投瑞银基金	王侃
中长期纯债型	019654.OF	天弘招享三个月定开	2023-11-21	0.10	天弘基金	刘洋

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理

上周首发基金

上周有 30 只基金首次进入发行阶段,其中天弘招享三个月定开、英大安华纯债 A、广发中证国新央企股东回报联接 A 已经结束发行并成立。

表7: 上周首发基金列表 (仅展示初始份额, 亿份)

投资类型	基金代码	基金名称	发行日期	认购起始日	认购终止日	基金管理人	基金经理	募集份额 上限,亿
中长期纯债型	019048.OF	嘉实汇享 30 天持有纯债 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-01	嘉实基金	林洪钧,杨烨超	-
中长期纯债型	019262.OF	中信保诚嘉盛三个月定开 A	2023-11-20	2023-11-20	2024-02-19	中信保诚基金	杨穆彬	80
中长期纯债型	019931.OF	泰康悦享 30 天持有 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-05	泰康基金	黄钟	-
中长期纯债型	019581.OF	浦银安盛悦享 30 天持有 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-13	浦银安盛基金	曹治国	-
中长期纯债型	019489.OF	景顺长城景泰通利纯债 A	2023-11-20	2023-11-20	2024-02-19	景顺长城基金	陈健宾,赵天彤	-
中长期纯债型	019654.OF	天弘招享三个月定开	2023-11-20	2023-11-20	2023-11-20	天弘基金	刘洋	-
中长期纯债型	020060.OF	鹏扬淳旭 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-18	鹏扬基金	管悦	-
中长期纯债型	020050.OF	英大安华纯债 A	2023-11-21	2023-11-21	2023-11-22	英大基金	吕一楠	80
中长期纯债型	018924.OF	南方金添利三年定开 A	2023-11-24	2023-11-24	2023-12-14	南方基金	李璇	-
偏债混合型	019752.OF	海富通悦享一年持有 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-08	海富通基金	江勇	-
偏股混合型	019820.OF	鹏华远见精选 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-11-24	鹏华基金	王子建	-
偏股混合型	019780.OF	嘉实创新动力 A1	2023-11-24	2023-11-24	2023-11-30	嘉实基金	杨欢	-
增强指数型	159555.OF	银华中证 2000 增强策略 ETF	2023-11-22	2023-11-22	2023-11-28	银华基金	张凯,张亦驰	20
普通股股票型	019505.OF	国泰君安中证 1000 优选 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-08	国泰君安资管	胡崇海	10
普通股股票型	019561.OF	富国致航量化选股 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-01	富国基金	王保合	40
混合债券型二级	018644.OF	金鹰悦享 A	2023-11-20	2023-11-20	2024-02-19	金鹰基金	林暉	-
混合债券型二级	020069.OF	恒生前海恒源臻利 A	2023-11-21	2023-11-21	2024-02-20	恒生前海基金	张昆	-
混合型 FOF	018914.OF	华夏聚嘉优选三个月持有 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-15	华夏基金	卢少强	50
混合型 FOF	018712.OF	浦银安盛招睿精选 3 个月持有 A	2023-11-20	2023-11-20	2024-02-19	浦银安盛基金	陈曙亮	-
被动指数型	159559.OF	景顺长城国证机器人产业 ETF	2023-11-20	2023-11-20	2023-11-24	景顺长城基金	张晓南	-
被动指数型	159350.OF	富国深证 50ETF	2023-11-20	2023-11-20	2023-11-24	富国基金	苏华清	-
被动指数型	159150.OF	易方达深证 50ETF	2023-11-20	2023-11-20	2023-11-24	易方达基金	鲍杰,成曦	80
被动指数型	562063.OF	华宝标普中国 A 股红利机会 ETF	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-04	华宝基金	胡洁	-
被动指数型	018926.OF	南方中证电池主题指数 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-01	南方基金	李佳亮	-
被动指数型	560303.OF	汇添富中证电信主题 ETF	2023-11-20	2023-11-20	2023-11-30	汇添富基金	晏阳	-
被动指数型	019428.OF	广发中证国新央企股东回报联接 A	2023-11-20	2023-11-20	2023-11-22	广发基金	罗国庆	30
被动指数型	560783.OF	广发中证半导体材料设备主题 ETF	2023-11-20	2023-11-20	2023-11-28	广发基金	夏浩洋	30
被动指数型	159562.OF	华夏中证沪深港黄金产业股票 ETF	2023-11-21	2023-11-21	2023-12-01	华夏基金	华龙	20
被动指数型债券	019616.OF	西藏东财同业存单指数 7 天持有	2023-11-20	2023-11-20	2023-12-01	西藏东财基金	王宇飞	50
被动指数型债券	019790.OF	宝盈中债 0-5 年政策性金融债 A	2023-11-24	2023-11-24	2024-01-23	宝盈基金	程逸飞	80

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理

本周待发行基金

本周将有 26 只基金进入发行阶段, 其中中长期纯债型 (8 只)、偏股混合型 (6 只)、被动指数型债券 (4 只)。

表8: 本周待发行基金列表 (仅展示初始份额)

投资类型	基金代码	基金名称	发行日期	认购起始日	认购终止日	基金管理人	基金经理	募集份额 上限,亿
中长期纯债型	020135.OF	华富吉禄 90 天滚动持有 A	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-06	华富基金	倪莉莎	-
中长期纯债型	019939.OF	长信 120 天滚动持有 A	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-29	长信基金	杜国昊	30
中长期纯债型	020078.OF	金信民富 A	2023-11-27	2023-11-27	2024-02-27	金信基金	杨杰	-
中长期纯债型	019806.OF	华安月月鑫 30 天持有 A	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-08	华安基金	郑如熙,马晓璇	80
中长期纯债型	020133.OF	东方红 60 天持有纯债 A	2023-11-29	2023-11-29	2023-12-22	东证资管	李燕	20
中长期纯债型	018676.OF	渤海汇金汇享益利率债 A	2023-11-29	2023-11-29	2024-02-28	渤海汇金资管	高延龙	30
中长期纯债型	019502.OF	信澳悦享利率债	2023-11-29	2023-11-29	2023-12-05	信达澳亚基金	赵琳婧	-
中长期纯债型	019398.OF	国投瑞银恒睿添利 A	2023-12-01	2023-12-01	2023-12-12	国投瑞银基金	李达夫	50
偏股混合型	019394.OF	浦银安盛策略优选 A	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-15	浦银安盛基金	杨富麟	-
偏股混合型	018750.OF	山西证券精选行业 A	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-22	山西证券	庄波	-
偏股混合型	019119.OF	财通资管产业优选 A	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-08	财通证券资管	李晶	10
偏股混合型	020064.OF	西部利得科技创新 A	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-15	西部利得基金	陈蒙	20
偏股混合型	018705.OF	财通鼎欣量化选股 18 个月定开	2023-11-29	2023-11-29	2024-02-28	财通基金	朱海东	-
偏股混合型	019367.OF	长城均衡成长 A	2023-12-01	2023-12-01	2023-12-21	长城基金	廖瀚博	80
增强指数型	020160.OF	中信保诚沪深 300 指数增强 A	2023-11-29	2023-11-29	2023-12-13	中信保诚基金	姜鹏	80
增强指数型	019918.OF	招商中证 2000 指数增强 A	2023-12-01	2023-12-01	2023-12-20	招商基金	王平,王岩	20
普通股股票型	019941.OF	富国洞见价值 A	2023-12-01	2023-12-01	2023-12-21	富国基金	白冰洋	-
混合债券型二级	018765.OF	汇添富稳丰回报 A	2023-11-29	2023-11-29	2024-02-28	汇添富基金	吴振翔	-
混合型 FOF	018688.OF	鑫元鑫选稳健养老目标一年持有	2023-11-27	2023-11-27	2024-02-26	鑫元基金	徐欢	10
混合型 FOF	012306.OF	浦银安盛养老目标日期 2050 五年持有	2023-11-28	2023-11-28	2024-02-27	浦银安盛基金	缪夏美	-
被动指数型	020110.OF	富国恒生港股通医疗保健联接 A	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-01	富国基金	田希蒙	50
被动指数型	588903.OF	南方上证科创板 100ETF	2023-11-29	2023-11-29	2023-12-05	南方基金	朱恒红	-
被动指数型债券	019017.OF	汇丰晋信同业存单指数 7 天持有	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-08	汇丰晋信基金	傅煜清,蔡若林	100
被动指数型债券	018453.OF	蜂巢同业存单指数 7 天持有	2023-11-27	2023-11-27	2023-12-08	蜂巢基金	李海涛	50
被动指数型债券	018809.OF	长信同业存单指数 7 天持有	2023-11-30	2023-11-30	2023-12-11	长信基金	杜国昊	100
被动指数型债券	020044.OF	东方红中债 0-3 年政策性金融债 A	2023-12-01	2023-12-01	2023-12-28	东证资管	高德勇	80

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理

附：开放式公募基金前 N 名业绩明细

表9：周度业绩前三的普通公募基金（截至 2023.11.24）

类型，一级	基金代码	基金名称	基金成立日	本周收益	本年收益
货币型基金	000210.OF	光大现金宝 A	2013-09-05	0.09%	1.54%
货币型基金	007858.OF	鹏华浮动净值型	2019-08-29	0.08%	1.26%
货币型基金	000760.OF	工银财富快线 A	2015-06-19	0.05%	1.62%
短期纯债基金	270043.OF	广发理财年年红	2012-07-19	0.20%	2.41%
短期纯债基金	000792.OF	招商定期宝六个月	2017-06-16	0.11%	0.43%
短期纯债基金	011961.OF	易方达稳鑫 30 天滚动持有 A	2021-04-08	0.10%	2.94%
灵活配置型基金	164403.OF	前海开源沪港深农业主题精选 A	2016-07-20	4.85%	-1.76%
灵活配置型基金	004724.OF	先锋聚元 A	2017-11-17	3.21%	6.53%
灵活配置型基金	001940.OF	农银汇理现代农业加	2016-01-29	3.01%	-10.03%
混合债二级基金	010174.OF	英大智享 A	2020-12-23	1.27%	5.18%
混合债二级基金	003167.OF	前海开源鼎瑞 A	2016-08-16	0.37%	3.64%
混合债二级基金	001957.OF	嘉合磐通 A	2018-01-24	0.37%	0.02%
混合债一级基金	650001.OF	英大纯债 A	2013-04-24	1.02%	3.11%
混合债一级基金	970039.OF	天风六个月滚动持有 A	2021-09-22	0.20%	6.86%
混合债一级基金	013579.OF	鹏扬丰利一年定开 A	2022-05-24	0.18%	4.79%
平衡混合型基金	012963.OF	招商稳健平衡 A	2021-10-19	0.84%	0.48%
平衡混合型基金	012332.OF	上银鑫尚稳健回报 6 个月持有 A	2021-07-20	0.68%	-4.94%
平衡混合型基金	009649.OF	嘉实精选平衡 A	2020-06-11	0.53%	2.92%
另类基金	008856.OF	华夏安泰对冲策略 3 个月定开	2020-06-05	0.50%	10.77%
另类基金	000667.OF	工银绝对收益 A	2014-06-26	0.39%	-2.81%
另类基金	008831.OF	海富通安益对冲 A	2020-01-22	0.28%	4.99%
偏债混合型基金	012521.OF	英大稳固增强核心一年持有 A	2021-12-14	1.35%	1.07%
偏债混合型基金	009499.OF	景顺长城安鑫回报 A	2020-07-10	0.67%	-4.36%
偏债混合型基金	009154.OF	海富通富盈 A	2020-05-20	0.65%	0.45%
主动权益	016307.OF	景顺长城北交所精选两年定开 A	2022-08-23	15.69%	-
主动权益	016303.OF	中信建投北交所精选两年定开 A	2022-08-16	14.32%	-
主动权益	014294.OF	南方北交所精选两年定开	2021-11-23	13.69%	12.46%
中长期纯债基金	002904.OF	博时安仁一年定开 A	2016-06-24	3.61%	6.26%
中长期纯债基金	008430.OF	人保利丰纯债 A	2022-09-09	1.16%	-
中长期纯债基金	014511.OF	英大安盈 30 天滚动 A	2022-03-21	1.10%	1.48%

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理。注：统计期内如若基金仍处于建仓期，则对应统计期的业绩为空。

表10：周度超额业绩前十的指数增强基金（截至 2023.11.24）

类型，一级	基金代码	基金名称	基金成立日	本周超额	本年超额
指数增强型基金	005112.OF	银华中证全指医药卫生增强	2017-09-28	2.09%	-1.56%
指数增强型基金	010673.OF	兴全中证 800 六个月持有指数增强 A	2021-02-09	1.48%	11.45%
指数增强型基金	017505.OF	明亚中证 1000 指数增强 A	2023-04-25	1.32%	-
指数增强型基金	005965.OF	安信中证 500 指数增强 A	2018-11-29	1.17%	6.27%
指数增强型基金	015148.OF	华安中证 1000 指数增强 A	2022-07-12	1.05%	-
指数增强型基金	007994.OF	华夏中证 500 指数增强 A	2020-03-25	0.88%	9.49%
指数增强型基金	013233.OF	华夏中证 500 指数智选 A	2021-08-11	0.87%	9.24%
指数增强型基金	001050.OF	汇添富中证 500 指数增强 A	2015-02-16	0.86%	6.13%
指数增强型基金	016942.OF	工银瑞信中证 1000 指数增强 A	2023-03-28	0.85%	-
指数增强型基金	016785.OF	鹏华中证 1000 指数增强 A	2022-12-26	0.83%	-

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理。注：统计期内如若基金仍处于建仓期，则对应统计期的业绩为空。

表11: 周度业绩前十的量化对冲基金 (截至 2023.11.24)

类型, 一级	基金代码	基金名称	基金成立日	本周收益	本年收益
量化对冲型基金	008856.OF	华夏安泰对冲策略 3 个月定开	2020-06-05	0.50%	10.77%
量化对冲型基金	000667.OF	工银绝对收益 A	2014-06-26	0.39%	-2.81%
量化对冲型基金	008831.OF	海富通安益对冲 A	2020-01-22	0.28%	4.99%
量化对冲型基金	008838.OF	德邦量化对冲策略 A	2020-04-29	0.17%	0.61%
量化对冲型基金	008851.OF	景顺长城量化对冲策略三个月	2020-02-27	0.17%	3.18%
量化对冲型基金	001641.OF	富国绝对收益多策略 A	2015-09-17	0.16%	0.56%
量化对冲型基金	010668.OF	工银优选对冲 A	2020-12-30	0.07%	1.01%
量化对冲型基金	519062.OF	海富通阿尔法对冲 A	2014-11-20	0.07%	-1.73%
量化对冲型基金	008848.OF	国联智选对冲策略 3 个月定开	2020-04-03	0.05%	-6.63%
量化对冲型基金	860010.OF	光大阳光对冲策略 6 个月持有 A	2020-03-25	0.04%	2.08%

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理。注:统计期内如若基金仍处于建仓期,则对应统计期的业绩为空。

表12: 年度业绩前三的普通公募基金 (截至 2023.11.24)

类型, 一级	基金代码	基金名称	基金成立日	本周收益	本年收益
货币型基金	004121.OF	兴银现金添利 A	2016-12-30	0.03%	2.23%
货币型基金	001909.OF	创金合信货币 A	2015-10-22	0.03%	2.04%
货币型基金	003034.OF	平安日鑫 A	2016-09-23	0.03%	2.03%
短期纯债基金	007227.OF	海富通中短债 A	2019-09-24	0.02%	5.86%
短期纯债基金	004907.OF	长安泓沅中短债 A	2017-08-09	0.03%	4.94%
短期纯债基金	007194.OF	长城短债 A	2019-08-29	0.04%	4.92%
灵活配置型基金	001614.OF	东方区域发展	2016-09-07	-2.01%	48.36%
灵活配置型基金	290012.OF	泰信行业精选 A	2015-03-04	1.66%	37.83%
灵活配置型基金	001323.OF	东吴移动互联 A	2015-05-27	-5.27%	35.47%
混合债二级基金	970130.OF	国海证券安盈 A	2022-04-08	-0.59%	7.59%
混合债二级基金	970036.OF	华安证券睿赢一年持有 A	2021-12-03	-0.05%	7.02%
混合债二级基金	013204.OF	恒生前海恒源天利 A	2021-08-18	-0.39%	6.45%
混合债一级基金	000244.OF	天弘稳利 A	2013-07-19	-0.08%	12.00%
混合债一级基金	007091.OF	东兴兴福一年定开 A	2019-04-10	0.17%	10.73%
混合债一级基金	163825.OF	中银互利定期开放	2017-11-09	-0.07%	9.15%
平衡混合型基金	009649.OF	嘉实精选平衡 A	2020-06-11	0.53%	2.92%
平衡混合型基金	217002.OF	招商安泰平衡	2003-04-28	0.48%	1.13%
平衡混合型基金	013983.OF	中金稳健增长 A	2022-03-15	-1.12%	0.58%
另类基金	159985.OF	华夏饲料豆粕期货 ETF	2019-09-24	-2.24%	14.39%
另类基金	000218.OF	国泰黄金 ETF 联接 A	2016-04-13	-1.43%	12.93%
另类基金	518880.OF	华安黄金 ETF	2013-07-18	-1.41%	12.87%
偏债混合型基金	001571.OF	嘉合磐石 A	2015-07-03	-0.35%	13.75%
偏债混合型基金	010923.OF	永赢鑫欣 A	2021-01-14	-0.32%	8.77%
偏债混合型基金	160323.OF	华夏磐泰 A	2016-12-26	-0.01%	8.70%
主动权益	001167.OF	金鹰科技创新 A	2015-04-30	-3.54%	36.92%
主动权益	014283.OF	华夏北交所创新中小企业精选两年定开	2021-11-23	10.81%	35.75%
主动权益	210009.OF	金鹰核心资源 A	2012-05-23	-3.49%	35.45%
中长期纯债基金	007769.OF	东兴兴瑞一年定开 A	2019-09-06	0.16%	11.26%
中长期纯债基金	003260.OF	博时利发纯债 A	2016-09-07	-0.12%	8.33%
中长期纯债基金	009461.OF	东方臻萃 3 个月定开债 A	2020-05-21	0.17%	8.01%

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理。注:统计期内如若基金仍处于建仓期,则对应统计期的业绩为空。

表13: 年度超额业绩前十的指数增强基金（截至 2023.11.24）

类型, 一级	基金代码	基金名称	基金成立日	本周超额	本年超额
指数增强型基金	012415.OF	德邦上证 G60 综指增强 A	2021-09-29	0.72%	12.03%
指数增强型基金	010673.OF	兴全中证 800 六个月持有指数增强 A	2021-02-09	1.48%	11.45%
指数增强型基金	006048.OF	长城中证 500 指数增强 A	2018-08-13	0.60%	10.31%
指数增强型基金	007994.OF	华夏中证 500 指数增强 A	2020-03-25	0.88%	9.49%
指数增强型基金	013233.OF	华夏中证 500 指数智选 A	2021-08-11	0.87%	9.24%
指数增强型基金	015466.OF	太平中证 1000A	2022-04-29	0.70%	9.17%
指数增强型基金	001397.OF	建信精工制造指数增强	2015-08-26	0.18%	8.44%
指数增强型基金	006034.OF	富国 MSCI 中国 A 股国际通增强 A	2018-12-25	0.23%	7.59%
指数增强型基金	502000.OF	西部利得中证 500 指数增强 A	2020-02-19	0.23%	7.46%
指数增强型基金	167601.OF	国金沪深 300 指数增强 A	2017-09-01	-1.10%	7.18%

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理。注:统计期内如若基金仍处于建仓期,则对应统计期的业绩为空。

表14: 年度业绩前十的量化对冲基金（截至 2023.11.24）

类型, 一级	基金代码	基金名称	基金成立日	本周收益	本年收益
量化对冲型基金	008856.OF	华夏安泰对冲策略 3 个月定开	2020-06-05	0.50%	10.77%
量化对冲型基金	008835.OF	富国量化对冲策略三个月持有 A	2020-02-25	-0.03%	5.62%
量化对冲型基金	008831.OF	海富通安益对冲 A	2020-01-22	0.28%	4.99%
量化对冲型基金	008851.OF	景顺长城量化对冲策略三个月	2020-02-27	0.17%	3.18%
量化对冲型基金	000753.OF	华宝量化对冲 A	2014-09-17	0.01%	2.28%
量化对冲型基金	860010.OF	光大阳光对冲策略 6 个月持有 A	2020-03-25	0.04%	2.08%
量化对冲型基金	001073.OF	华泰柏瑞量化收益	2015-06-29	-0.15%	1.93%
量化对冲型基金	002804.OF	华泰柏瑞量化对冲	2016-05-26	-0.03%	1.62%
量化对冲型基金	010668.OF	工银优选对冲 A	2020-12-30	0.07%	1.01%
量化对冲型基金	000414.OF	嘉实绝对收益策略 A	2013-12-06	-0.07%	0.95%

资料来源:Wind、国信证券经济研究所整理。注:统计期内如若基金仍处于建仓期,则对应统计期的业绩为空。

免责声明

分析师声明

作者保证报告所采用的数据均来自合规渠道；分析逻辑基于作者的职业理解，通过合理判断并得出结论，力求独立、客观、公正，结论不受任何第三方的授意或影响；作者在过去、现在或未来未就其研究报告所提供的具体建议或所表述的意见直接或间接收取任何报酬，特此声明。

国信证券投资评级

投资评级标准	类别	级别	说明
报告中投资建议所涉及的评级（如有）分为股票评级和行业评级（另有说明的除外）。评级标准为报告发布日后6到12个月内的相对市场表现，也即报告发布日后的6到12个月内公司股价（或行业指数）相对同期相关证券市场代表性指数的涨跌幅作为基准。A股市场以沪深300指数（000300.SH）作为基准；新三板市场以三板成指（899001.CSI）为基准；香港市场以恒生指数（HSI.HI）作为基准；美国市场以标普500指数（SPX.GI）或纳斯达克指数（IXIC.GI）为基准。	股票 投资评级	买入	股价表现优于市场代表性指数20%以上
		增持	股价表现优于市场代表性指数10%-20%之间
		中性	股价表现介于市场代表性指数±10%之间
		卖出	股价表现弱于市场代表性指数10%以上
	行业 投资评级	超配	行业指数表现优于市场代表性指数10%以上
		中性	行业指数表现介于市场代表性指数±10%之间
		低配	行业指数表现弱于市场代表性指数10%以上

重要声明

本报告由国信证券股份有限公司（已具备中国证监会许可的证券投资咨询业务资格）制作；报告版权归国信证券股份有限公司（以下简称“我公司”）所有。本报告仅供我公司客户使用，本公司不会因接收人收到本报告而视其为客户。未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式使用、复制或传播。任何有关本报告的摘要或节选都不代表本报告正式完整的观点，一切须以我公司向客户发布的本报告完整版本为准。

本报告基于已公开的资料或信息撰写，但我公司不保证该资料及信息的完整性、准确性。本报告所载的信息、资料、建议及推测仅反映我公司于本报告公开发布当日的判断，在不同时期，我公司可能撰写并发布与本报告所载资料、建议及推测不一致的报告。我公司不保证本报告所含信息及资料处于最新状态；我公司可能随时补充、更新和修订有关信息及资料，投资者应当自行关注相关更新和修订内容。我公司或关联机构可能会持有本报告中所提到的公司所发行的证券并进行交易，还可能为这些公司提供或争取提供投资银行、财务顾问或金融产品等相关服务。本公司的资产管理部门、自营部门以及其他投资业务部门可能独立做出与本报告中所提及的意见或建议不一致的投资决策。

本报告仅供参考之用，不构成出售或购买证券或其他投资标的的要约或邀请。在任何情况下，本报告中的信息和意见均不构成对任何个人的投资建议。任何形式的分享证券投资收益或者分担证券投资损失的书面或口头承诺均为无效。投资者应结合自己的投资目标和财务状况自行判断是否采用本报告所载内容和信息并自行承担风险，我公司及雇员对投资者使用本报告及其内容而造成的一切后果不承担任何法律责任。

证券投资咨询业务的说明

本公司具备中国证监会核准的证券投资咨询业务资格。证券投资咨询，是指从事证券投资咨询业务的机构及其投资咨询人员以下列形式为证券投资人或者客户提供证券投资分析、预测或者建议等直接或者间接有偿咨询服务的活动：接受投资人或者客户委托，提供证券投资咨询服务；举办有关证券投资咨询的讲座、报告会、分析会等；在报刊上发表证券投资咨询的文章、评论、报告，以及通过电台、电视台等公众传播媒体提供证券投资咨询服务；通过电话、传真、电脑网络等电信设备系统，提供证券投资咨询服务；中国证监会认定的其他形式。

发布证券研究报告是证券投资咨询业务的一种基本形式，指证券公司、证券投资咨询机构对证券及证券相关产品的价值、市场走势或者相关影响因素进行分析，形成证券估值、投资评级等投资分析意见，制作证券研究报告，并向客户发布的行为。

国信证券经济研究所

深圳

深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 36 层
邮编：518046 总机：0755-82130833

上海

上海浦东民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 12 层
邮编：200135

北京

北京西城区金融大街兴盛街 6 号国信证券 9 层
邮编：100032