由于世界经济下行风险上升、国内疫情多发散发等多因素影响,市场情绪受到压制。10月A股震荡下行,整体结构化表现明显,板块风格变化加剧。其中,计算机、国防军工、电子等行业占优;而9月非常抗跌的食品饮料、房地产、煤炭等行业,在10月跌幅居前。

从私募表现来看,据私募排排网的数据,百亿私募最新数量为111家,其中有27家百亿私募在10月取得了正收益,其中量化型私募就有13家,占据了半壁江山。

## 为助力有志

于从事量化投资策略及

量化交易的优秀私募管理人的发展,

申

港证

券携手云

财富期货联合举办

2022 "申享智投杯" 第二届量化私

## 募实盘大赛

,对于总榜单排名靠前且符合条件的私募,提供主办方自有资金投资机会,与优秀 量化私募基金管理人共同成长。

## 本届大赛面向量化

私募产品,根据产品投资策略不同,

大赛分为

套利策略、量化对冲策略、趋势策略

三个组别

,每个组别下包含多个细分策略。实盘竞赛阶段从2022年5月1日起,至2022年10月31日止。

从10月的榜单统计来看,套利策略组参赛产品平均收益率为0.25%,首尾收益差为10.36%,正收益占比为60.55%;量化对冲组平均收益率为-0.28%,首尾收益差为16.54%,正收益占比为46.43%;趋势交易组平均收益率为0.04%,首尾收益差为40.60%,正收益占比为52.16%。



2/5

## 二、量化对冲策略

量化对冲策略,包括股票量化多空、股票量化对冲、股票动态对冲、期货量化对冲 、期权量化对冲、定增融

券对冲、宏观量化对冲等细分。

10月量化对冲策略组的榜单冠军由奕睿私募基金的"奕\*\*泰"摘得。

奕睿私募基金管理(上海)有限公司成立于2021年,管理规模在0~5亿,专注于量化投资,以分散投资为核心理念,通过多策略、多品种、多周期的分散配置,追求稳定的收益。



4/5

大赛依据当月绝对收益率进行月榜排名,并给选手准备了丰厚的权益。各组的月榜冠军选手,除了奖杯外,还可受邀成为私募排排网的路演主讲嘉宾,路演视频可触达私募排排网的百万高净值用户。大赛总榜将按累计收益率、最大回撤幅度、夏普比率、规模因子进行定量评分,决出套利策略、量化对冲策略、趋势交易策略三组的总冠军。三只总榜冠军产品,将获得"申享智投最佳量化私募基金产品"称号,颁发奖杯与证书,

有机会获得最高1000万元投资机会

。不仅如此,大赛还特别设有"申享智投雏鹰奖",成功参赛的私募管理人,可获得私募排排网《基金大师》1年的免费使用权限。

另外,年化收益率达10%以上且全历史业绩满足投放条件的已开户参赛产品,有机会在比赛期间优先获得200~500万元投资机会。