

为了更好地研究稳健型私募产品的业绩表现，私募排排网统计了最近一年、三年和五年，按夏普比率排名的分策略最稳私募基金产品排行榜，致力于为投资者提供最有价值的参考。除了考察区间回撤和业绩排名，其中纳入一年期最稳产品排名还需满足近一月净值创新高，纳入三年期和五年期最稳产品排名需满足近三月净值创新高。

夏普比率是由1990年诺贝尔经济学奖得主William Sharp提出，它衡量的是单位总风险上的超额收益，是可以同时对收益与风险加以综合考虑的三大经典指标之一。简单来说，它就是帮助投资者选择这样一种投资组合，即在同等的收益率水平上最小化风险。

以下为榜单详情：

一年期最稳健股票策略产品排行榜

- 1 鹤骑鹰一粟 鹤骑鹰投资 1-10亿 上海 4.82
- 2 苏华智稳盈七期 华智汇金 1-10亿 苏州 4.16
- 3 混沌天成博益安盈精英7号 博益安盈 1-10亿 深圳 3.41
- 4 财掌柜持股宝八号 同亨投资 1-10亿 厦门 3.04
- 5 社润航诚私募基金 社润投资 1-10亿 成都 3.02
- 6 天倚道幻方星辰7号 天倚道投资 10-20亿 上海 2.85
- 7 中邮永安向胤量化先锋2号 中邮永安资产 10-20亿 上海 2.84
- 8 致远进取一号 珠海致诚卓远 50亿以上 珠海 2.68
- 9 睿扬精选2号 睿扬投资 1-10亿 上海 2.55
- 10 石锋资产重剑二号 石锋资产 1-10亿 上海 2.54

数据来源：私募排排网数据中心，取距离9月底最近一天公布的净值参与排名

私募排排网点评：

在近一年最稳健股票策略私募基金产品排行榜中，排名第一的是来自鹤骑鹰投资的“鹤骑鹰一粟”，该产品近一年夏普比率为4.82。根据私募排排网组合大师数据，鹤骑鹰投资管理有限公司成立于2010年5月，上创始股东即投资团队均为博士，分别毕业自北京大学、复旦大学和武汉大学的金融、物理、软件工程等专业。

获得近一年最稳健股票策略私募基金产品亚军的是来自华智汇金的“复苏华智稳盈七期”，该产品最近一年夏普比率录得4.16。“苏华智稳盈七期”成立于2018年3月，产品年化收益10.08%，产品最大回撤控0.34%。

位居近一年最稳健股票策略私募基金产品排行榜季军的是来自博益安盈的“混沌天成博益安盈精英7号”，录得近一年夏普比率为3.41。

一年期最稳健管理期货产品排行榜

- 1 蓝色天际8号 蓝色天际投资 1-10亿 北京 4.75
- 2 泓大量化CTA1号 泓大资产 1-10亿 广州 4.39
- 3 雷根启明1号 雷根资产 10-20亿 上海 4.31
- 4 恒健远志量化对冲1期 恒健远志 1-10亿 深圳 3.99
- 5 弘源量化1号 弘源泰平资管公司 1-10亿 深圳 3.64
- 6 盛世基金 雷根资产 10-20亿 上海 3.57
- 7 德兴泉聚1号 中科德兴 1-10亿 厦门 3.55
- 8 蓝色天际-宽宏1号 蓝色天际投资 1-10亿 北京 3.39
- 9 棋剑CTA3号 棋剑资产 1-10亿 上海 3.31
- 10 时代复兴东兆长泰CTA二号 元贞铭至 1-10亿 宁波 3.16

在近一年最稳管理期货策略私募基金产品排行榜中，来自蓝色天际投资的“蓝色天际8号”勇夺桂冠，近一年夏普比率录得为4.75。该产品由陆敏杰担任近基金经理，陆敏杰本人在2005年获北京邮电大学计算机硕士学位，后在通讯领域从事7年软件研发工作，于2012年初加入北京蓝色天际投资有限责任公司，主要负责自有量化投资软件平台的研发，程序化交易策略的研发，以及实盘自营资金的运营管理。20

15年担任投资总监，带领团队不断丰富量化策略，以丰富的量化投资经验为投资人和股东带来满意的业绩回报。

一年期最稳健组合基金产品排行榜

1 中邮永安鸿安稳利FOF2号 中邮永安资产 10-20亿 上海 4.19

2 众星1号 信弘天禾资产 20-50亿 北京 3.63

3 细水长量1号 好投投资 10-20亿 广州 3.00

4 新方程对冲精选H1号 新方程 50亿以上 上海 2.75

5 新方程大类配置 新方程 50亿以上 上海 2.59

6 珠池量化稳健投资母基金1号 珠池资产 20-50亿 上海 2.20

7 丽岙新动力安盈组合 华软新动力 10-20亿 杭州 2.18

8 臣君-多策略组合启航1号 臣君资本 1-10亿 北京 2.11

9 曜石对冲母1号 曜石资产 1-10亿 深圳 1.98

10 社润精诚二号 社润投资 1-10亿 成都 1.95

中邮永安资产的“中邮永安鸿安稳利FOF2号”近一年夏普比率4.19，位于榜单第一名。据私募排排网了解，中邮永安成立于2017年1月，由北京中邮资产管理有限公司（中邮集团全资子公司）、浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司（永安期货、敦和资管、天堂硅谷合资子公司）共同出资组建，是一家目前以FOF为主营业务的资产管理公司。中邮永安融合了中邮的金融平台和永安以及相关单位的投顾、投研资源，以自有资金领投、金融工具增值服务为核心业务。

一年期最稳健相对价值产品排行榜

1 盛泉恒元量化1号 盛泉恒元 20-50亿 南京 4.88

2 丰衍财富与日聚金 丰衍财富 1-10亿 深圳 4.85

3 淘利多策略14号 淘利资产 10-20亿 上海 4.65

4 丰衍财富绝对收益 丰衍财富 1-10亿 深圳 4.46

5 申毅华聚1号 申毅投资 10-20亿 上海 4.45

6 翔云套利2号 翔云资产 1-10亿 广州 4.08

7 联海量化期权1号 联海资产 10-20亿 拉萨 4.04

8 天白云中燕三期 山东天宝投资 1-10亿 淄博 3.98

9 嘉诚海狮1号 海狮投资 1-10亿 上海 3.97

10 九章幻方量化对冲1号 幻方量化 50亿以上 杭州 3.82

近一年最稳健相对价值策略产品排行榜冠军是来自盛泉恒元的“盛泉恒元量化1号”。盛泉恒元善于发现并投资于较资本市场主流投资存在一定折价的品种，通过丰富、灵活的组合策略运作，在获取市场机会的同时，有效抵御市场波动风险。根据私募排排网组合大师数据，盛泉恒元成立以来年化收益10.25%，最大回撤4.98%，公司管理规模在20~50亿。

一年期最稳健复合策略产品排行榜

1 幻方恒光01号 幻方量化 50亿以上 杭州 4.281428

2 歆享资产富诚二期 歆享资产 1-10亿 上海 4.11

3 幻方永途01号 宁波幻方量化 20-50亿 宁波 4.00

4 复熙恒赢7号 复熙资产 10-20亿 上海 3.82

5 雷根添宝全天候一号 雷根资产 10-20亿 上海 3.79

6 天使2号 泛融金资产 1-10亿 北京 3.69

7 歆享资产富诚三期 歆享资产 1-10亿 上海 3.69

8 雷根混合型1号 雷根资产 10-20亿 上海 3.47

9 歆享资产稳健一号 歆享资产 1-10亿 上海 3.43

10 盛世汉武6号 盛世资产 1-10亿 深圳 3.38

一年期最稳健复合策略产品排行榜冠军是幻方量化的“幻方恒光01号”，近一年夏普比率4.28。幻方量化在2019年新晋百亿私募行列，公司是一家依靠数学与计算机科学进行量化投资的对冲基金公司。创始团队于2008年开始致力于量化对冲领域的研究、创新与实践，依靠强大的系统、独特的模型、严谨的风控，始终保持令人瞩目的投资业绩。幻方量化还是国内金融衍生品交易与设计的领先者，始终走在创新的前沿。

一年期最稳健固定收益产品排行榜

1 明毅固益五号 明毅博厚 50亿以上 北京 7.57

2 雪杉常升1号 雪杉基金 10-20亿 深圳 6.04

3 征途-宗略稳市债1号 征途投资 1-10亿 深圳 5.97

4 宁聚高收益债券3期 宁波宁聚 20-50亿 宁波 5.97

5 宁聚理财年年红6期短期固定收益 宁波宁聚 20-50亿 宁波 5.38

6 正前方强债2号 正前方基金 10-20亿 深圳 5.34

7 泛融金-东方红1号 泛融金资产 1-10亿 北京 5.33

8 越秀大奖章 越秀鲲鹏 1-10亿 广州 5.28

9 仁和智本债券平衡型3号 上海仁和智本 1-10亿 上海 5.27

10 长流致远十二号 长流资本 1-10亿 深圳 4.81

私募排排网点评：

获得近一年最稳健固定收益策略产品排行榜冠军的是来自百亿私募明毅博厚的“明毅固益五号”，该产品近一年夏普比率为7.57。“明毅固益五号”成立于2017年8月，由刘灿、李元丰共同担任基金经理。明毅博厚专注固定收益证券投资，同时打造以宏观资产配置和流动性管理为核心的投资交易和研究分析团队。

本文源自私募排排网

更多精彩资讯，请来金融界网站(www.jrj.com.cn)