

中信建投财富·内部代销评估参考

睿量私募基金 管理人深度画像

管理人：上海睿量私募基金管理有限公司

登记编号：P1073883

数据更新日期：2026-08-19

本材料仅供内部代销评估与陪伴服务使用，不构成投资建议。市场有风险，投资需谨慎。

资料来源：管理人提供的尽调材料及公开信息，具体数据以管理人最新披露为准。

公司介绍

上海睿量私募基金管理有限公司成立于**2022年7月7日**，登记编号**P1073883**，是一家专注于量化选股与指数增强策略的私募基金管理公司。公司注册资本及实缴资本均为**1000万元**，于2023年1月成为中国证券投资基金业协会观察会员。

公司定位：以多因子量化选股为核心，结合机器学习与贝叶斯方法，在A股市场捕捉短期定价偏差，力争实现显著且可解释的超额收益。

核心竞争优势

- 高素质团队协同：团队成员毕业于海内外知名高校，投研人员具备计算机、物理、数学、统计、金融等复合背景。
- 丰富从业经验：公司成员平均从业年限超13年，投研团队平均从业年限超11年，策略实盘运行超11年并历经多轮迭代。
- 独立自研体系：自主研发研究、交易及风控系统，方法论与市场同类策略相关性较低。
- 策略适应能力强：历经多轮牛熊及极端行情考验，模型持续迭代更新。
- 卓越交易能力：深耕A股市场，擅长捕捉短线投资机会并高度关注交易贡献。

基本信息

成立时间

2022年7月7日

登记编号

P1073883

注册资本

1000万元

实缴资本

1000万元

协会资格

观察会员

管理规模

未披露

团队介绍

核心投研人员

王博·投资总监

毕业于北京大学微电子专业，具有10年以上量化从业经验，擅长股票量化策略研究与投资，对多因子、机器学习等有深入研究；曾就职于上海证大投资、佳期投资等知名量化私募。

其他核心成员

信息待补充

投研 / 技术团队

公司团队成员均毕业于海内外知名高校，投研团队拥有计算机、物理、数学、统计、金融等多学科复合背景；公司成员平均从业年限超13年，投研团队平均从业年限超11年。团队自主研发搭建了研究、交易及风控系统，形成策略独立性与稳定性支撑。

投资策略

睿量以量化选股为核心策略，融合量价因子、基本面因子与A股特色因子，通过机器学习算法进行权重分配与组合优化，并借助贝叶斯概率与交易执行增厚收益。

策略特点

因子类型：量价 + 基本面 + A股特色

组合方式：机器学习算法

概率框架：贝叶斯概率

收益增厚：日内高频交易

相关性：与同类策略相关性低

优化目标：风险收益比最大化

核心模块 / 投研流程

数据准备与处理

统一采集、清洗并存储多源数据，为因子研究与模型训练提供高质量数据基础。

因子构建

覆盖动量、反转、技术指标、日内盘口情绪、成长估值、公司质量及A股特色因子，动态优化因子配比与权重。

组合策略

基于机器学习算法进行权重分配，将多类子策略组合为稳健的交易策略。

交易执行

自主研发交易系统，利用日内高频数据与交易执行算法增厚产品收益。

收益来源

- 选股Alpha：通过多因子模型与机器学习挖掘个股预期收益差异。
 - 交易增厚：基于A股短线交易机会与高频数据获取交易收益。
 - 因子配置：根据市场环境动态调整因子权重，提升风险收益比。
-

代销产品

1. 量化选股

策略特点：全市场量化选股，以多因子模型与机器学习为核心，结合贝叶斯概率框架动态调整因子权重，追求长期、显著的超额收益；策略与同类管理人相关性较低，不依赖短期成交量与波动率。

收益来源：主要来源于量化选股Alpha及交易执行增厚，通过捕捉A股短期定价偏差与风格延续机会获取收益。

代表产品：睿量原子1号 成立日期：2022年9月7日 统计区间：2022/09/30—2026/08/14 当前规模：3.2亿元

5.3989单位净值	1.87%本周收益	28.12%今年收益
439.89%累计收益	53.41%年化收益	2.09夏普比率

月度收益表现

年份	类型	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	YTD	月胜率
PDF未披露月度收益明细，数据待补充															

注：管理人材料仅披露季度收益数据，未提供月度收益明细。过往业绩不代表未来表现，数据来源于管理人及托管人复核的净值材料。

风控体系

睿量建立覆盖事前、事中、事后的全流程风控体系：事前通过多因子风险模型控制组合在风格、行业及个股层面的暴露；事中依托自研交易系统实时监控仓位与敞口；事后持续进行绩效归因与策略复盘。具体风控特色包括上限等权重选股以降低个股风险、优化个股及行业权重以降低统计外行业暴露、利用贝叶斯概率框架降低因子风险并提升因子收益。