

中信建投财富·内部代销评估参考

上海蒙玺投资管理有限公司 管理人深度画像

管理人：上海蒙玺投资管理有限公司

登记编号：P1063294

数据更新日期：2026-08-20

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

上海蒙玺投资管理有限公司成立于2016年，是中国证券投资基金业协会观察会员，业内知名量化对冲基金公司。公司聚焦全频段Alpha策略，深耕短周期赛道，追求长期Pure Alpha，管理资产规模逾200亿元。

核心竞争优势：工程化投研路线，全链路模块化分工；核心团队在低延迟领域积累深厚，长期处于行业第一梯队；每年上亿级IT投入，自建高性能低延迟研究平台与算力集群；产品涵盖量化指增与量化对冲。

管理规模

200亿+

成立时间

2016年

登记编号

P1063294

投研占比

约70%

团队介绍

创始人&总经理

中国科学技术大学化学物理学士、美国布朗大学理论化学硕士；18年量化策略开发及交易经验，国内第一批从事量化交易的基金经理，2008年开始从事量化交易，2016年创立蒙玺投资。

投资策略

蒙玺全频段Alpha换仓频率达分钟级别，预测周期贯穿30分钟至3天多周期叠加。策略追求Pure Alpha，严控因子暴露敞口，以低延迟、高效率研究架构和非线性模型、深度学习为工具，覆盖量化指增与量化对冲产品线。

预测周期：30分钟~3天

策略频段：全频段叠加

AI应用：2019年引入非线性模型，2025年成立AI Lab

IT投入：每年上亿级

延迟水平：百纳秒级别

产品线：指增+对冲+光翼

数据平台

全球数据库，海量数据储备，除量价、基本面外每年千万级数据购买，Alpha来源多元分散。

因子与模型

特征工程与非线性模型、深度学习结合，持续迭代模型架构。

组合优化

组合优化与自研低延迟算法交易，提升执行效率。

AI Lab

2025年成立AI Lab，整合平台资源发力端到端、深度学习。

代销产品

1. 中证1000指数增强

策略特点：以中证1000指数为基准，通过全频段Alpha策略挑选具备超额收益潜力的一篮子股票，力求长期跑赢中证1000指数。

收益来源：主要来源于分钟级至日间多周期选股Alpha，通过低延迟平台与AI模型捕捉中小盘定价偏差。

代表产品：蒙玺中证1000指数量化5号 投资经理：李骧 统计区间：2023/06—2026/08/14

85.69%运作以来收益	55.45%策略迭代以来超额	28.01%策略迭代以来年化超额
-5.60%近一年超额最大回撤	8.19%超额年化波动率	1.87超额夏普

策略迭代起始日为2024年10月31日，月度收益明细请参见管理人PDF材料。

2. 沪深300对冲

策略特点：以沪深300指数为基准，通过全频段Alpha策略选股并使用沪深300股指期货对冲市场风险，追求稳健绝对收益。

收益来源：来源于沪深300成分股选股Alpha，通过对冲剥离市场Beta风险。

代表产品：蒙玺至嵘1号 投资经理：李骧 统计区间：2025/06—2026/08/14

11.97%累计收益	10.40%年化收益	-2.89%最大回撤
4.50%年化波动率	2.31夏普比率	3.60卡玛比率

月度收益明细及规模数据请参见管理人PDF材料。

风控体系

蒙玺基于Barra框架对行业和20多种风格因子敞口进行基准衡量和严格管理，采用软性与硬性约束因素以达到较优风险收益比例；全流程标准化、精细化，通过每日研究模型输出与交易模型输出比较核对，持续监控风险暴露与模型异常。