

中信建投财富·内部代销评估参考

量盈私募基金 管理人深度画像

管理人：量盈私募基金

登记编号：P1068580

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

浙江量盈投资管理有限公司成立于**2017年5月**，注册资本1000万元人民币（实缴），是中国证券投资基金业协会登记的私募证券投资基金管理人，并于2024年取得投顾资质（登记编号**P1068580**）。

公司定位：依靠数学、计算机科学进行量化投资的基金公司，在指数增强、量化选股、行业指数增强、CTA等多方面具备先进的研发与交易能力。

核心信息

公司全称

浙江量盈投资管理有限公司

成立时间

2017年5月

登记编号

P1068580

注册资本

1000万元（实缴）

管理规模

本次材料未披露

团队规模

25人

团队介绍

核心成员

王靖·CEO & 策略总监

浙江大学竺可桢学院混合班，卡耐基梅隆大学。从业经历十余年，曾先后任职于博世公司（硅谷）和美国谷歌公司，任高级软件工程师，负责广告部门人工智能平台的搭建。2016年创立量盈投资，现任量盈投资总经理及策略总监，主要负责策略的开发以及公司团队的管理。

王喆希·CTO

浙江大学，香港科技大学。从业十五年，曾任摩根大通（香港）衍生品交易部门副总裁，负责亚太地区衍生品（包括股票、期货、期权以及复杂衍生品）交易及市场，领导亚太市场量化程序开发。在量盈主要领导基于C++开发的交易以及风控系统的实施，策略底层开发系统的搭建。

投研 / 技术团队

团队现有25人，成员毕业于浙江大学、上海交通大学、厦门大学、卡耐基梅隆大学、弗吉尼亚大学等海内外名校，主要为金融工程、数学、物理、计算机等专业背景，核心成员均为国内外资产管理行业资深人士。

投资策略

量盈以量化投资为核心，基于机器学习和AI人工智能挖掘有效因子，覆盖指数增强、量化选股、行业指数增强、CTA等策略方向，通过多因子截面打分与日内择时信号灵活调仓。

股票策略共性特点

- 基于机器学习和AI人工智能挖掘有效因子，因子通过逻辑检验以保证长期有效性；实盘因子总数超过400个，共21个大类。
- 因子权重上量价因子占比约为80%，基本面及另类策略相关因子占比约为20%。
- Alpha模型：基于alpha因子分析估算未来3-10天拥有较强Alpha的股票。
- Beta仓位模型：模型连续分析估算未来多个周期的市场强弱，调整仓位占比。
- 日内根据T0信号短周期择时换仓，年换手约双边80-100倍左右（根据各产品线会有不同）。
- 同时使用自研及第三方算法交易系统，进一步降低交易成本。

代销策略线

新质生产力策略

量化科技增强策略，底层为人工智能、半导体、新能源三个科技行业增强，顶层叠加量化行业轮动信号。底层每个单行业增强对行业内股票进行多因子截面量化打分，预测未来3-10天强势股，叠加日内择时信号模型灵活调整仓位。持仓以大票为主，持股数量约60-200只，换手率约双边100倍。

分域量化多头策略

择时量化多头产品，底层由2000增强、新质生产力、红利增强三个策略组合而成。三个底层策略均带仓位择时信号，针对不同市场行情各自灵活调仓。持仓市值均衡，300、500、1000、2000及小票持有比例均在20%左右，持股数量约500-600只，换手率约双边80倍。

灵活对冲策略

中波产品，底层由1000中性、个股择时和分域量化多头三个策略组合而成。个股择时策略和分域量化多头策略均带仓位择时信号，针对不同市场行情各自灵活调仓。选股因子以量价因子为主（80%）、基本面因子为辅（20%），换手率约双边80倍。

投研流程

本次材料未披露完整投研流程。根据现有材料，策略研发主要依托因子挖掘、Alpha模型构建、Beta仓位模型、日内T0择时信号及算法交易执行等环节。

代销产品

以下新质生产力、分域量化多头、灵活对冲三条策略线已纳入中信建投财富代销评估体系，相关数据来源于管理人提供的经托管复核的净值材料，统计截至 **2026年8月14日**，具体以基金合同及管理人最新披露为准。

1. 新质生产力策略 代销

策略特点：量化科技增强策略，底层为人工智能、半导体、新能源三个科技行业增强，顶层叠加量化行业轮动信号，持仓以大票为主。

收益来源：通过科技行业内的多因子截面量化打分与日内择时，捕捉行业Alpha与个股Alpha。

代表产品：量盈新质生产力进取一号 成立日期：2025/01/20 起始计算日期：2025/02/10

2.3210 最新累计净值	+132.10% 累计收益	+75.30% 年化收益
49.98% 波动率	1.379 夏普	-37.34% 周度最大回撤
+29.00% 对标科创50年化超额	-0.08% 上周收益	60-200 只持股数量

月度收益表现

年份	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年度
2025年	—	+6.10%	-3.77%	+4.67%	+1.87%	+8.48%	+5.83%	+34.06%	+7.85%	-7.89%	+0.34%	+1.60%	+69.86%
2026年	+8.28%	+1.48%	-5.52%	+19.16%	+12.51%	+53.19%	-44.03%	+14.51%	+36.65%	—	—	—	—

数据来源：基金托管人，产品成立于2025年1月20日，数据截取区间2025年2月10日（运作日期）至2026年8月14日。基金的过往业绩不预示其未来表现。

2. 分域量化多头策略 代销

策略特点：择时量化多头产品，底层由2000增强、新质生产力、红利增强三个策略组合而成，三个底层策略均带仓位择时信号，持仓市值均衡。

收益来源：通过2000增强、新质生产力与红利增强三个子策略在不同行情下灵活调仓，获取多元化的Beta与Alpha收益。

代表产品：量盈乘风进取一号私募证券投资基金 成立日期：2025/09/08 起始计算日期：2025/09/17

1.2010最新累计净值	+20.10%累计收益	+22.46%年化收益
32.01%波动率	0.794夏普	-20.90%周度最大回撤
+0.92%上周收益	500-600只持股数量	

月度收益表现

年份	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年度
2025年	—	—	—	—	—	—	—	—	-0.40%	-2.11%	+1.85%	+1.21%	+0.50%
2026年	+8.26%	+3.59%	-4.70%	+11.73%	+2.17%	+15.66%	-24.19%	+11.72%	+19.50%	—	—	—	—

数据来源：基金托管人，实盘产品成立于2025年9月8日，数据截取区间2025年9月17日（运作日期）至2026年8月14日。基金的过往业绩不预示其未来表现。

3. 灵活对冲策略 代销

策略特点：中波产品，底层由1000中性、个股择时和分域量化多头三个策略组合而成，选股因子以量价因子为主（80%）、基本面因子为辅（20%）。

收益来源：通过市场中性、个股择时与分域量化多头的组合，在控制波动的同时获取稳健绝对收益。

代表产品：量盈灵活对冲策略（具体产品名称本次材料未披露） 成立日期：2025/01/20 起始计算日期：2025/01/20

1.2293最新净值	+22.93%累计收益	+14.17%年化收益
12.64%波动率	1.112夏普	-12.29%最大回撤（周度）
-0.395%当周收益		

月度收益表现

年份	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年度
2025年	-0.33%	+0.85%	-0.17%	+4.43%	+3.31%	+2.47%	+1.92%	+6.53%	+2.03%	-2.28%	+2.21%	-1.24%	+21.22%
2026年	+5.10%	+1.76%	-2.07%	+2.82%	-0.80%	+1.40%	-10.38%	+4.47%	+1.42%	—	—	—	—

数据来源：基金托管人，产品成立于2025年1月20日，数据截取区间2025年1月20日至2026年8月14日。基金的过往业绩不预示其未来表现。

注：以上数据均为管理人提供的经托管复核材料，具体以基金合同及管理人最新披露为准。基金的过往业绩不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成基金业绩表现的保证。

风控体系

本次材料未披露完整风控体系。根据团队介绍，CTO王喆希负责基于C++开发的交易及风控系统实施、策略底层开发系统搭建。策略层面通过多因子模型、仓位择时模型及自研与第三方算法交易系统进行交易成本控制与敞口管理。