

转让上海私募股权备案公司可发产品

产品名称	转让上海私募股权备案公司可发产品
公司名称	北京中诚卓越企业管理咨询有限公司
价格	90000.00/个
规格参数	品牌:中诚卓越 地址:北京
公司地址	北京市朝阳区大鲁店文化街16号3幢2层2027
联系电话	15300396862

产品详情

各位老板们好，有需要上海私募股权公司的注意了，上海私募股权备案公司可发产品，公司干净无异常，有需要的老板们可以联系我，祝您生意兴隆。

基金管理人定性定量分析亮点：

上海私募股权备案公司可发产品

1、多策略及CTA策略业绩**，且规模适中；

上海私募股权备案公司可发产品

2、团队合作时间久，CTA策略运行时间较长。

上海私募股权备案公司可发产品

这两天，你们的朋友圈有没有被“上海原来还有这么牛的人”刷屏，不得不说，这个事情确实蹊跷，多亏网友们眼尖。

如果给过去两个月上海发生的奇闻异事做个区域性排名，[宝山区](#)至少能排进三甲。各个区都各有特色，但宝山这块主要是和物资过不去。

笔者自己也是住在宝山区，不过住在犄角旮旯的社区，物资发放还算及时，满打满算估计发了有十几次物资，所以还算不错

上海私募股权备案公司可发产品。

虽然说“

上海原来还有这么

牛的人”是贬义，但笔者今天想说的

这家上海原来还有这么牛X的[私募机构](#)，却是褒义，借标题来表达下笔者的肯定。

从管理情况上来看。这家公司是上海WD投资，公司成立于2016年，登记于2017年年初，有第三方投顾资质。公司目前管理规模为15亿左右。近年来获得多项私募实盘大赛、券商及其他三方机构颁发的奖项，其实如果有留意过那些机构榜单的话，会经常看到这家机构的名字。

公司目前员工共计二十几人，其中投研人员共计十几位，投研人员占比达到64%。团队核心人员来自国内985及英美知名高校硕士、博士，具有物理学、数学、经济学背景，其策略开发并无明确分工，属共同研发策略，流水线作业。公司核心投研C负责公司的架构和策略风控，L负责具体策略研发。

股权方面，从外部网站查询，股权持有人为C（投研负责人）和法人Z。但公司现搭建成熟的组织架构及先进的[合伙人制度](#)，以便于保持公司核心投研团队的稳定。上海私募股权备案公司可发产品

上海私募股权备案公司可发产品

从公司产品情况上看。量化私募的成长绝不部分是从CTA策略起家的，WD也不例外。目前管理规模15亿，形成了CTA策略、股票策略、宏观对冲策略的基本覆盖中国主流标的多策略体系。从发行产品上来看，发行不到30只产品，产品投资策略为多策略、CTA、指增。笔者着重介绍其多策略产品。

量化CTA策略。是纯[程序化交易](#)。CTA策略自2010年投研开始，至今已超过十年，

上海私募股权备案公司可发产品

到目前策略体系经过几次大的改进。其以量价因子为主，趋势跟踪与套利交易为主，占比相对比较稳定，主要收益来自市场波动率变化下捕捉

到的趋势，也会使用一些[日内交易策略](#)

，在

日内策略

中，提高交易频率

以更好控制波动。该策略是覆盖全市

场主流、交易量大的品种，以[商品期货](#)

为主。交易品种约四五十个，单品种仓位上限5%，单品种资金分配趋于均衡。保证金占比约20-30%。持仓周期为2-3天

。在管理人的子策略组合优化

方法上，其有一套独特方法，并称之为场景[预测模型](#)

，说实话，笔者对这个模型不是很理解哈，个人感觉有些通过模型预测，后期进行人为处理并干预的意思。

期货套利策略，主要包括无风险套利、强关联套利及弱关联套利。其中以强关联套利为主，占比约60-70%，主要有做市、跨期（低频）套利、配对交易；弱关联套利以期货多空（期货因子模型），产业链套利为主；无风险套利占比*小，包括期现套利、ETF套利、高频价差套利。其交易品种四五十个。保证金占比比CTA策略要略高。

指数增强策略。说实话，管理人的指增策略和其他家的策略略有区别，笔者感觉应该归为复合策略。其具体策略指数增强策略+股票多空策略。资金大部分应用于股票端，具体选用300选股模型。基于全A选股，量价因子为主。采用基本面因及另类基本面因子，生成目标持仓约50-80只股票，换手率约为40到60倍，单票仓位上限10%。其

次，在选股策略基础上，会搭配上IF、IH股指期货[远期合约](#)

进行对冲，不留风险敞口，形成一个赚取纯粹选股带来的Alpha收益的股票多空策略。不过有些时候也会

在股指上做趋势跟踪，进行择时对冲，形成一个赚取Beta+Alpha的择时对冲指数增强策略，所以该策略并非完全程序化交易。

宏观对冲策略

，通过大类资产配置，多策略获得稳健收益。目前子策略覆盖股票、期货及[债券市场](#)，赚取资产轮动Beta收益及资产内部Alpha收益。该策略我们就不做过多介绍了。

上海私募股权备案公司可发产品

代表产品方面，多策略产品的组成是50%股票策略+50%CTA策略，代表产品是成立时间*早的多策略一号，于2017年运行以来[年化收益率](#)18.3%，*大回撤12.1%。今年以来收益12.8%。

CTA策略代表产品XX5号，成立于19年6月，年化收益率27.6%，*大回撤8.4%，今年以来19.4%。300指数增强策略成立于19年6月，年化收益率24.3%，*大回撤12.9%，今年以来收益18.2%（是的，你没看错）。

产品风控方面，管理人主要通过事前事中事后的方式。具体方式在此就不做详解，与市场大多数私募机构风控措施大同小异。

外部机构合作方面。目前资金主要以直销资金为主，但机构客户较多，比较受证券期货公司自有资金及FOF青睐。但管理人合作的金融机构整体来看还不是特别多，未被市场充分挖掘，所以此阶段可能是资金方尽调拜访的好机会。不过话说回来，管理人的大部分产品是2020年以来才成立的，产品业绩两年左右，不排除其策略及规模刚好适应近段时间行情，所以还需等待时间的验证。

上海私募股权备案公司可发产品

上海私募股权备案公司可发产品