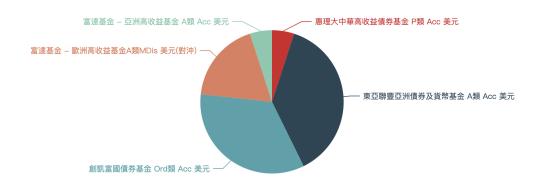
惠理大中華高收益債券基金 P類 Acc 美元 東亞聯豐亞洲債券及貨幣基金 A類 Acc 美元 創凱富國債券基金 Ord類 Acc 美元 富達基金 — 歐洲高收益基金A類MDis 美元(對沖)

■ 富達基金 - 亞洲高收益基金 A類 Acc 美元



期末持仓

がいいいと			
组合名称	我的组合		
组合开始日期	2014/1/2		
最近净值日期	2020/1/9		
资金规模	1000万元		
期末市值	1404.86万元		

累计收益走势

── 我的组合 **──** 基准1(沪深300) **──** 基准2(标普500)

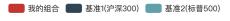
 $\underline{\downarrow}$



业绩评价

	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)		
年化收益	5.640%	9.89%	9.83%		
夏普比率	2.41	0.53	0.8		
年化波动率	2.29%	22.75%	12.82%		
最大回撤	4.85%	46.7%	19.78%		
95%VaR	-0.21%	-2.0%	-1.35%		

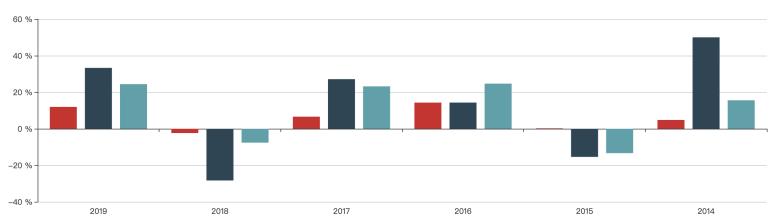
月度收益分布





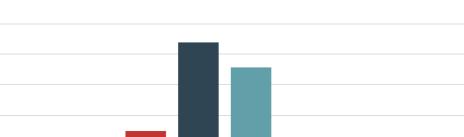
收益概率

	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
最近一周	0.31%	0.29%	0.52%
最近一月	1.38%	6.9%	4.42%
最近三月	2.35%	7.48%	11.46%
最近半年	3.85%	8.9%	8.64%
最近一年	11.71%	31.44%	22.62%



在度收益概率

	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
2019年	11.96%	33.32%	24.42%
2018年	-2.34%	-28.3%	-7.6%
2017年	6.62%	27.15%	23.21%
2016年	14.31%	14.34%	24.7%
2015年	0.23%	-15.4%	-13.33%
2014年	4.82%	50.05%	15.58%



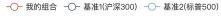
12 -10 -8 -6 -卡玛比率 夏普比率 索提诺比率 斯图泽比率

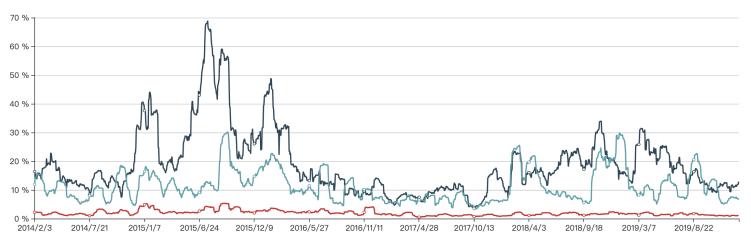
数 我的组合 基准1(沪深300)

业绩评价

	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
夏普比率	2.41	0.53	0.8
索提诺比率	3.52	0.73	1.11
斯图泽比率	4.95	10.77	9.13
卡玛比率	1.14	0.26	0.52

滚动年化波动率走势图





相关系数矩阵	惠理大中華高收益債券基金 P類 Acc 美元		創凱富國債券基金 Ord類 Acc 美元		富達基金 - 亞洲高收益基金 A類 Acc 美元
益債券基金 P類 Acc 美元	1	0.972	0.958	0.994	0.989
支貨幣基金 A類 Acc 美元	0.972		0.962	0.963	0.955
青券基金 Ord類 Acc 美元	0.958	0.962		0.955	0.918
基金A類MDis 美元(對沖)	0.994	0.963	0.955		0.99
§收益基金 A類 Acc 美元	0.989	0.955	0.918	0.99	1



 $\underline{\bot}$