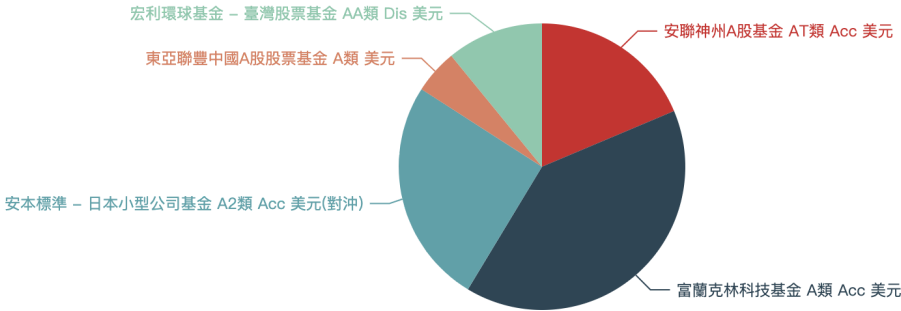


我的组合

- 安聯神州A股基金 AT類 Acc 美元
- 富蘭克林科技基金 A類 Acc 美元
- 安本標準 – 日本小型公司基金 A2類 Acc 美元(對沖)
- 東亞聯豐中國A股股票基金 A類 美元
- 宏利環球基金 – 臺灣股票基金 AA類 Dis 美元



期末持仓

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	2353.01万元

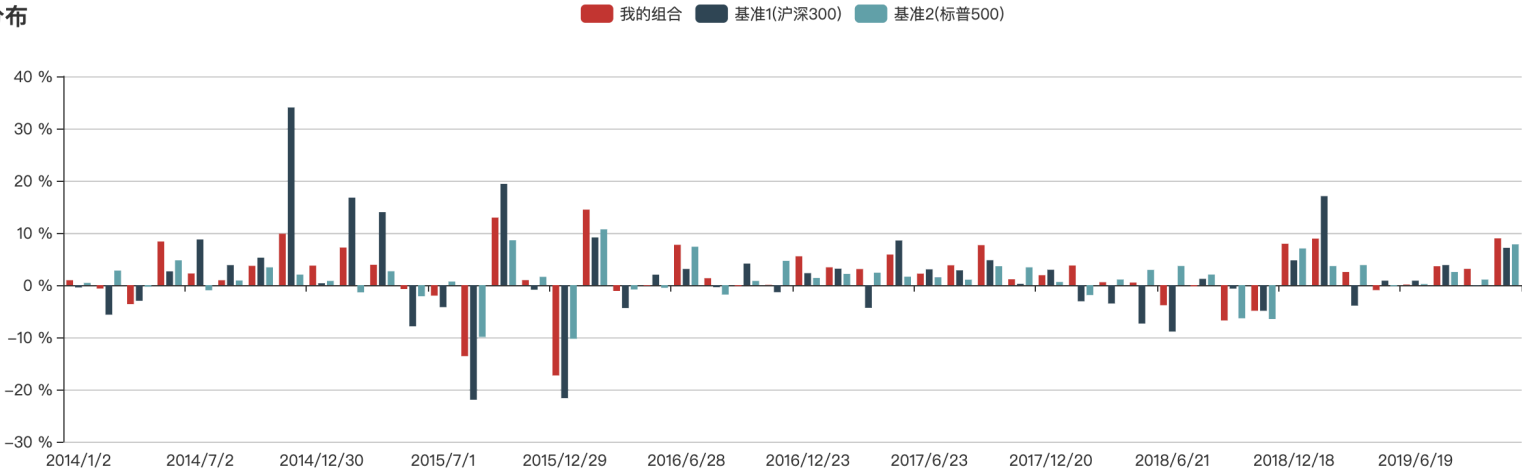
累计收益走势



业绩评价

	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
年化收益	14.90%	9.94%	9.88%
夏普比率	1.23	0.53	0.8
年化波动率	12.59%	22.84%	12.87%
最大回撤	25.91%	46.7%	19.78%
95%VaR	-1.22%	-2.0%	-1.39%

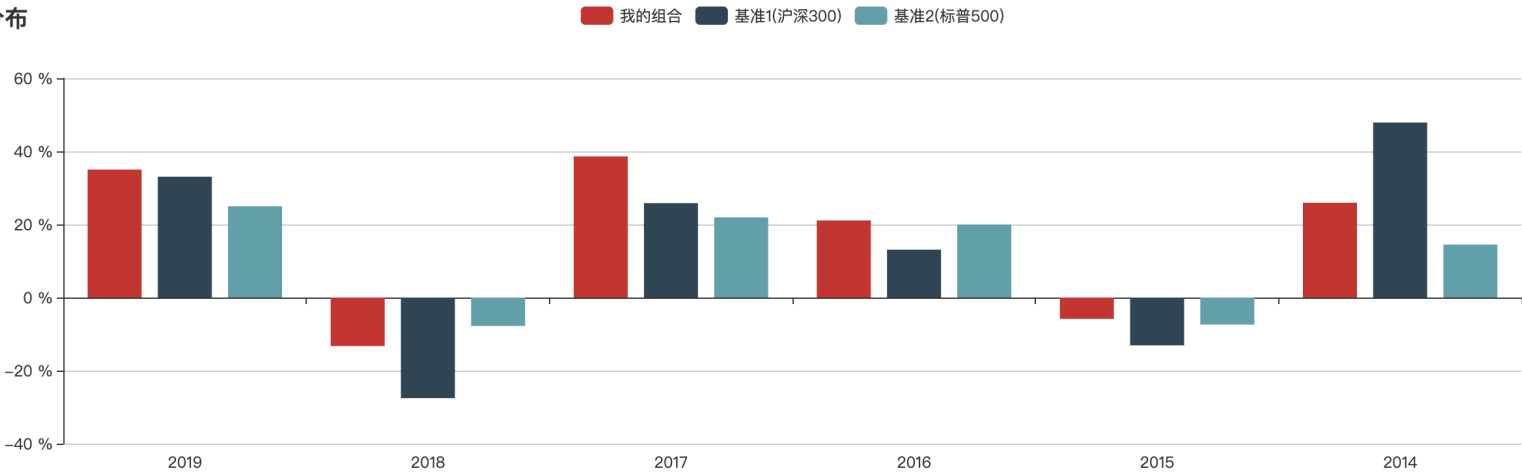
月度收益分布



收益概率

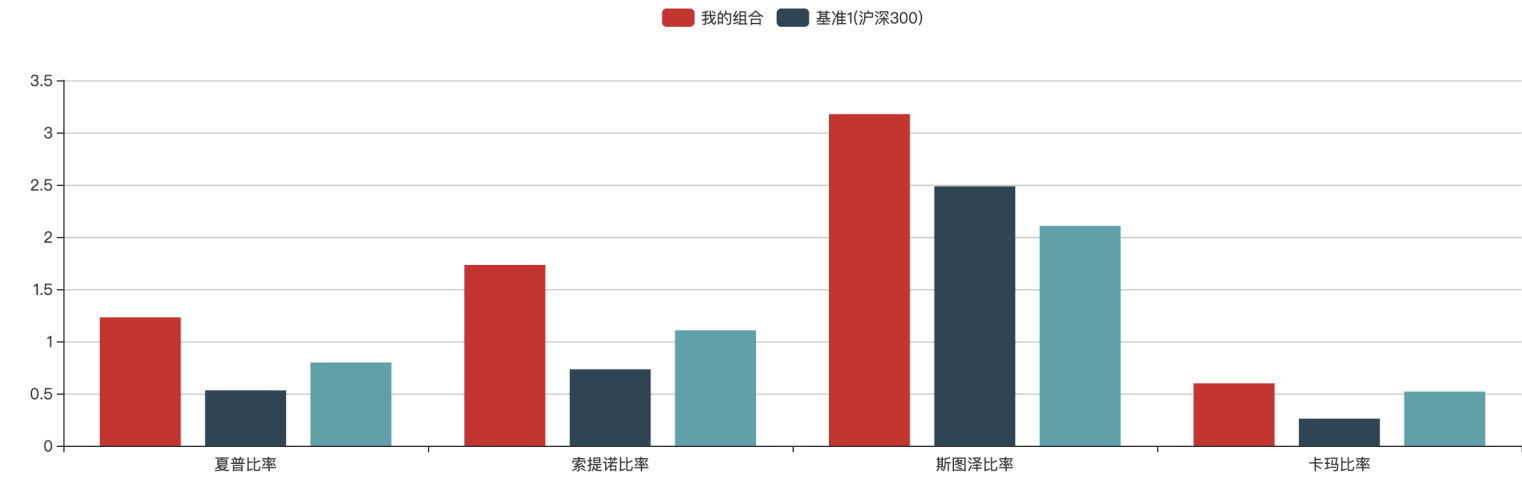
	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
最近一周	1.07%	0.29%	0.52%
最近一月	5.71%	6.9%	4.42%
最近三月	12.36%	7.48%	11.46%
最近半年	12.28%	8.9%	8.64%
最近一年	36.25%	33.84%	24.23%

年度收益分布



年度收益概率

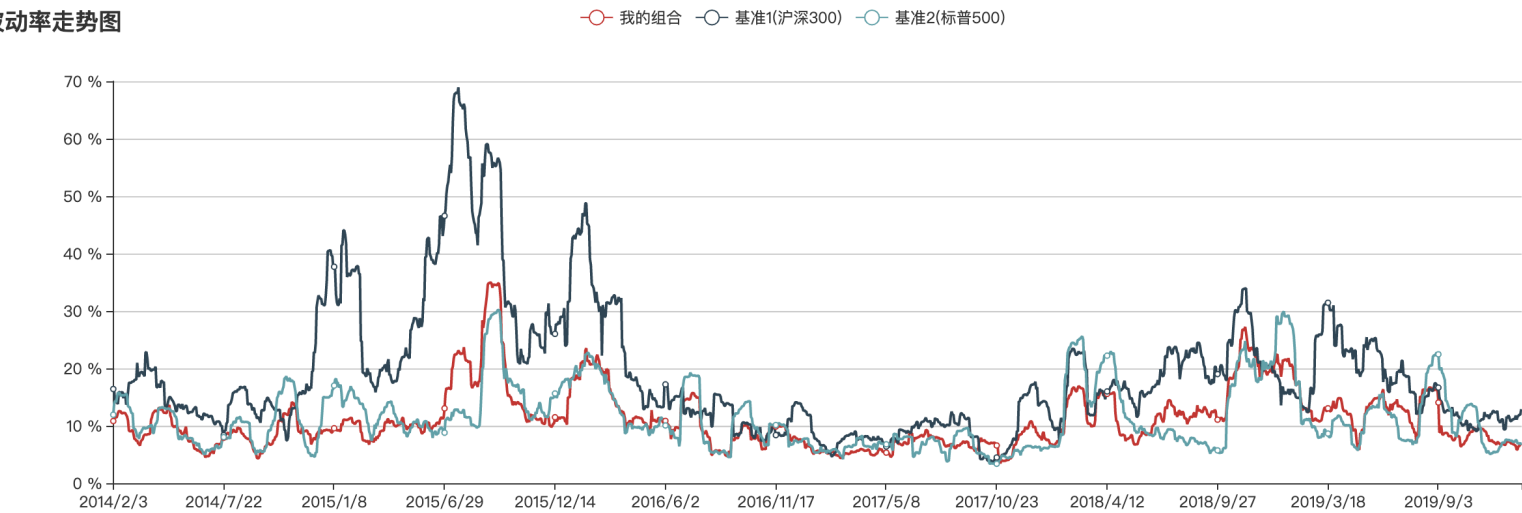
	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
2019年	35.02%	33.07%	24.98%
2018年	-13.28%	-27.53%	-7.76%
2017年	38.63%	25.84%	21.94%
2016年	21.1%	13.1%	19.99%
2015年	-5.83%	-13.09%	-7.4%
2014年	25.95%	47.9%	14.49%



业绩评价

	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
夏普比率	1.23	0.53	0.8
索提诺比率	1.73	0.73	1.11
斯图泽比率	3.18	2.48	2.11
卡玛比率	0.6	0.26	0.52

滚动年化波动率走势图



相关系数矩阵

