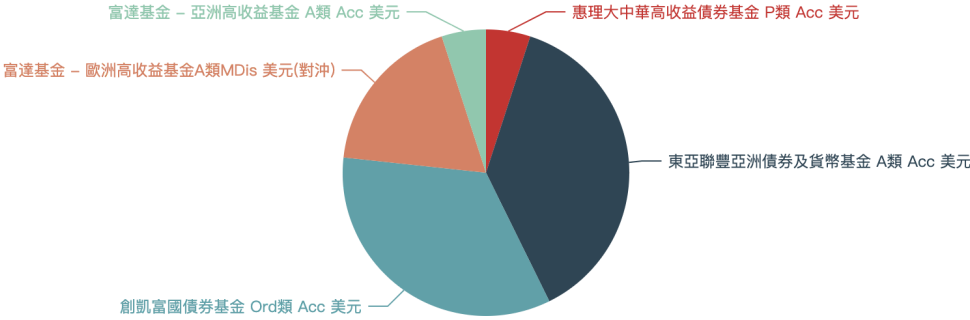


我的组合

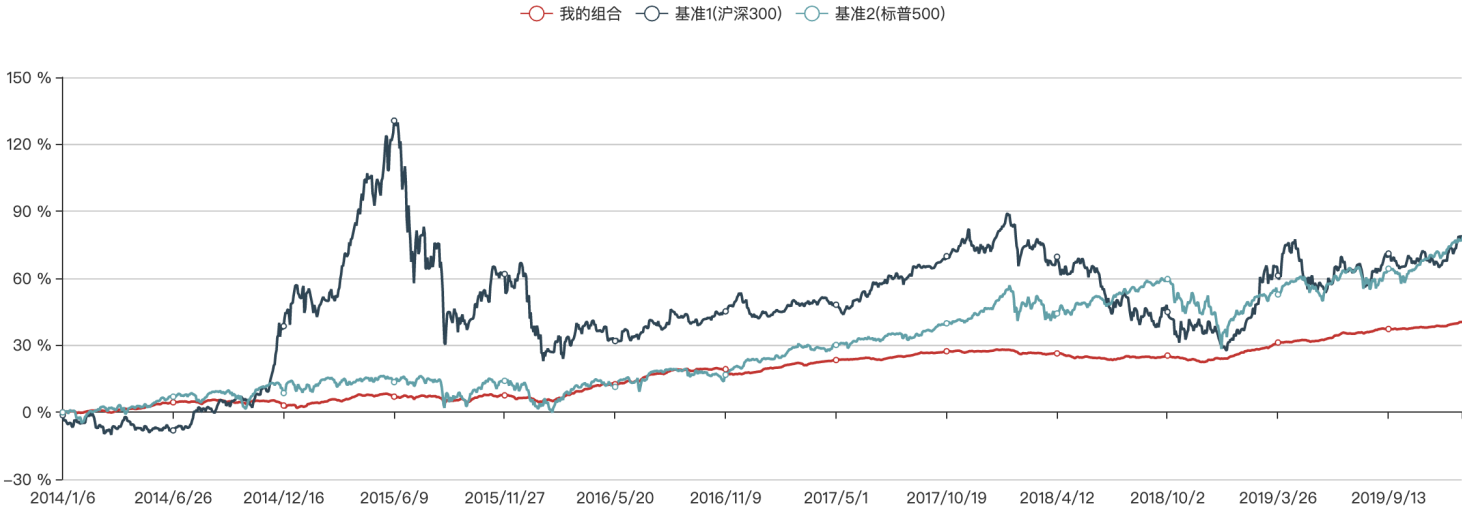
- 惠理大中華高收益債券基金 P類 Acc 美元
- 東亞聯豐亞洲債券及貨幣基金 A類 Acc 美元
- 創凱富國債券基金 Ord類 Acc 美元
- 富達基金 – 歐洲高收益基金A類MDIs 美元(對沖)
- 富達基金 – 亞洲高收益基金 A類 Acc 美元



期末持仓

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

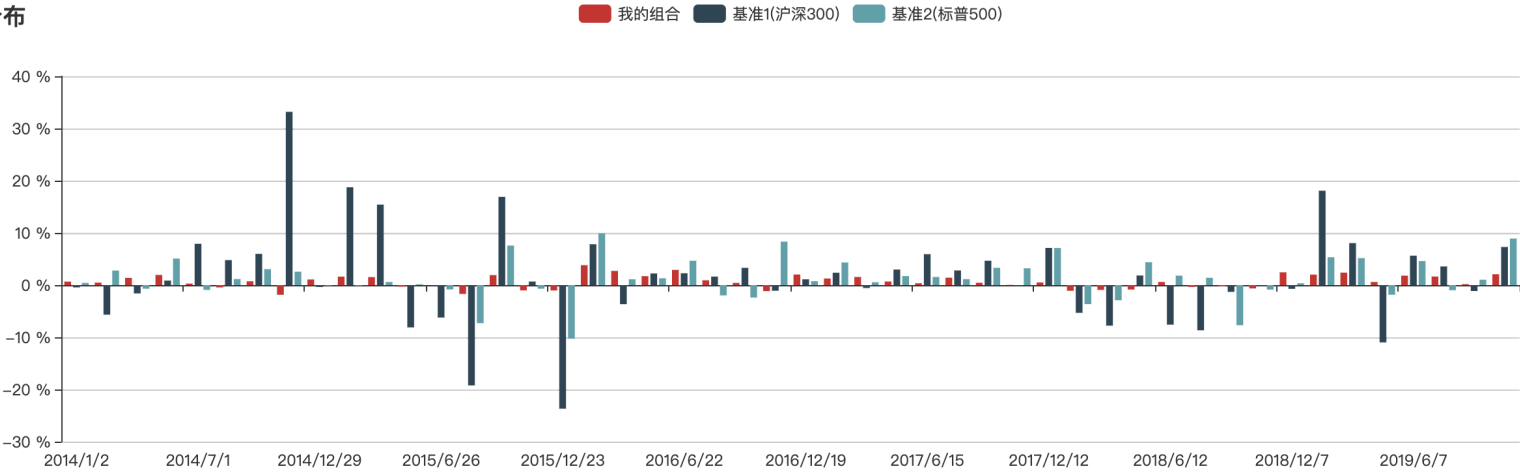
累计收益走势



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%

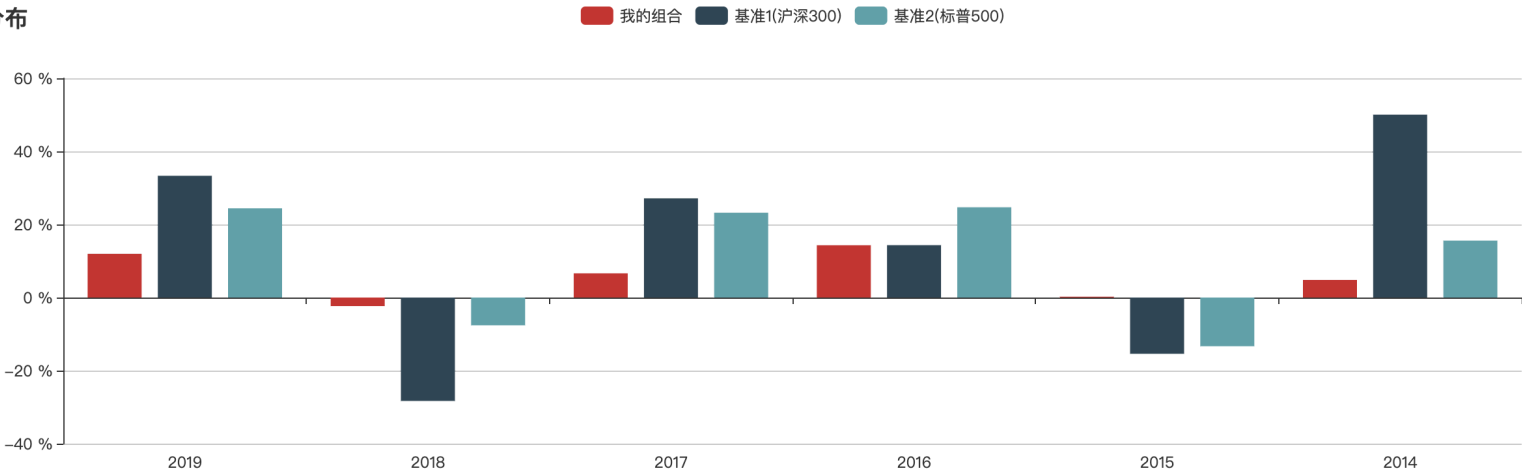
月度收益分布



收益概率

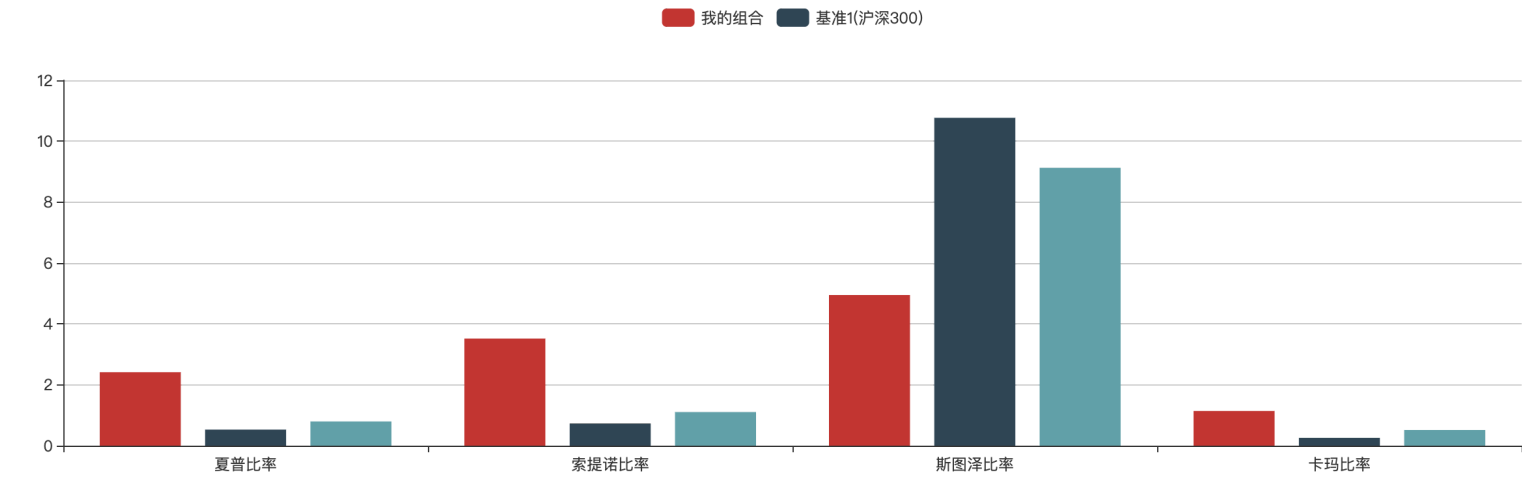
	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
最近一周	0.31%	0.29%	0.52%
最近一月	1.38%	6.9%	4.42%
最近三月	2.35%	7.48%	11.46%
最近半年	3.85%	8.9%	8.64%
最近一年	11.71%	31.44%	22.62%

年度收益分布



年度收益概率

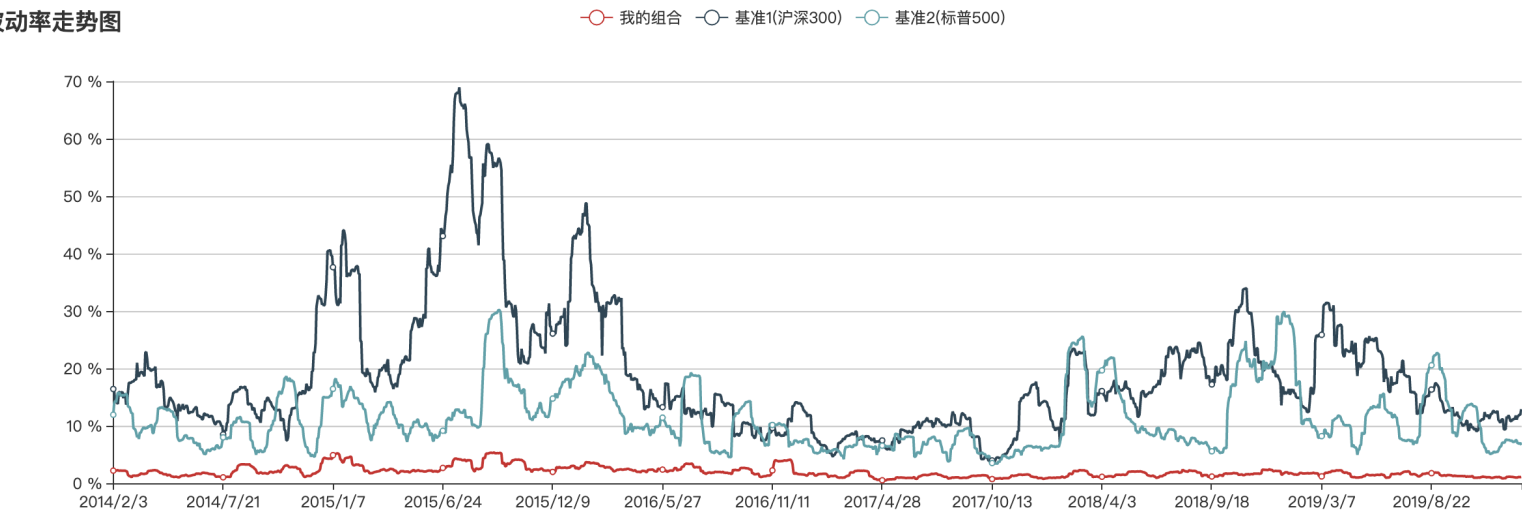
	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
2019年	11.96%	33.32%	24.42%
2018年	-2.34%	-28.3%	-7.6%
2017年	6.62%	27.15%	23.21%
2016年	14.31%	14.34%	24.7%
2015年	0.23%	-15.4%	-13.33%
2014年	4.82%	50.05%	15.58%



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

