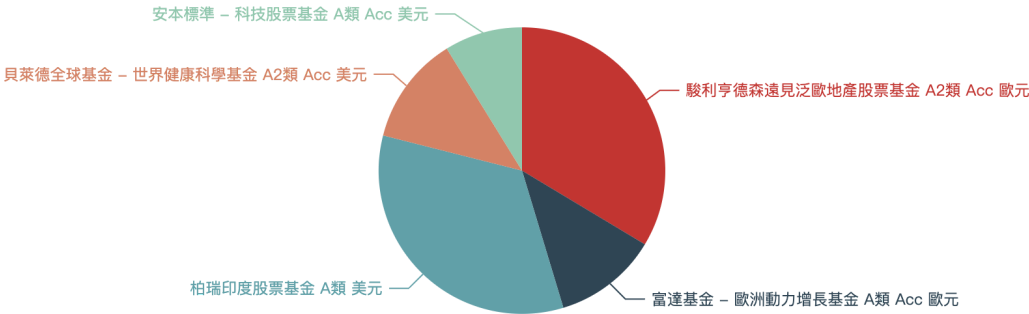


- 駿利亨德森遠見泛歐地產股票基金 A2類 Acc 歐元
- 富達基金 – 歐洲動力增長基金 A類 Acc 歐元
- 柏瑞印度股票基金 A類 美元
- 貝萊德全球基金 – 世界健康科學基金 A2類 Acc 美元
- 安本標準 – 科技股票基金 A類 Acc 美元

我的組合



期末持仓

組合名称	我的組合
組合开始日期	2014/1/2
最近净值日期	2020/1/9
资金规模	1000万元
期末市值	2060.37万元

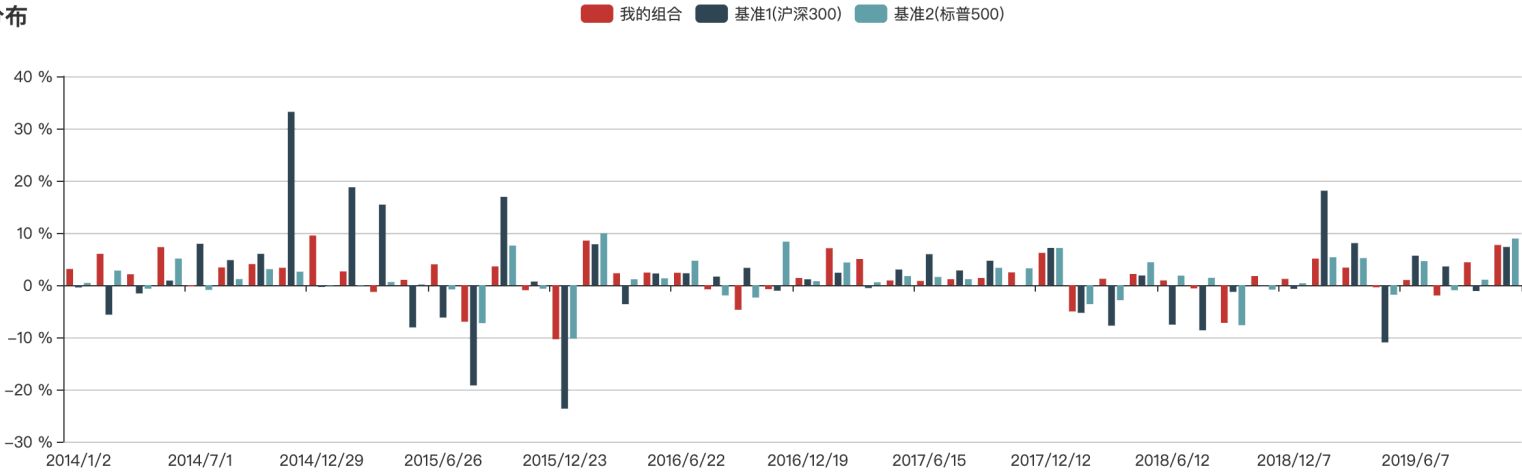
累计收益走势



业绩评价

	我的組合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
年化收益	12.380%	9.89%	9.83%
夏普比率	1.22	0.53	0.8
年化波动率	10.31%	22.75%	12.82%
最大回撤	16.8%	46.7%	19.78%
95%VaR	-1.04%	-2.0%	-1.35%

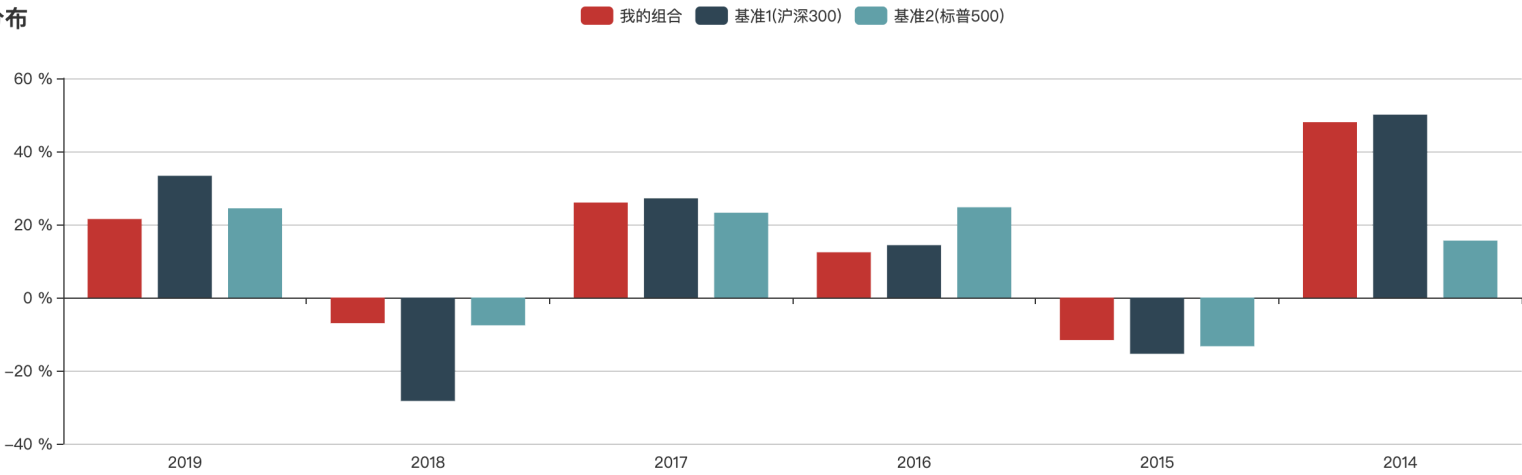
月度收益分布



收益概率

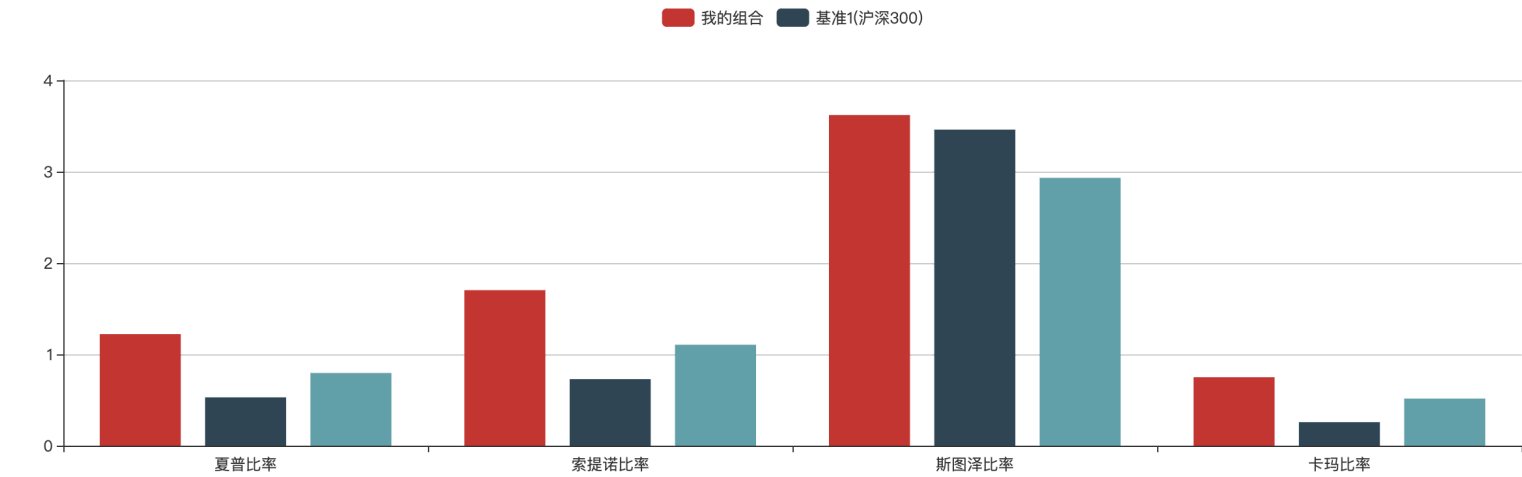
	我的組合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
最近一周	0.43%	0.29%	0.52%
最近一月	3.39%	6.9%	4.42%
最近三月	10.82%	7.48%	11.46%
最近半年	9.22%	8.9%	8.64%
最近一年	20.69%	31.44%	22.62%

年度收益分布



年度收益概率

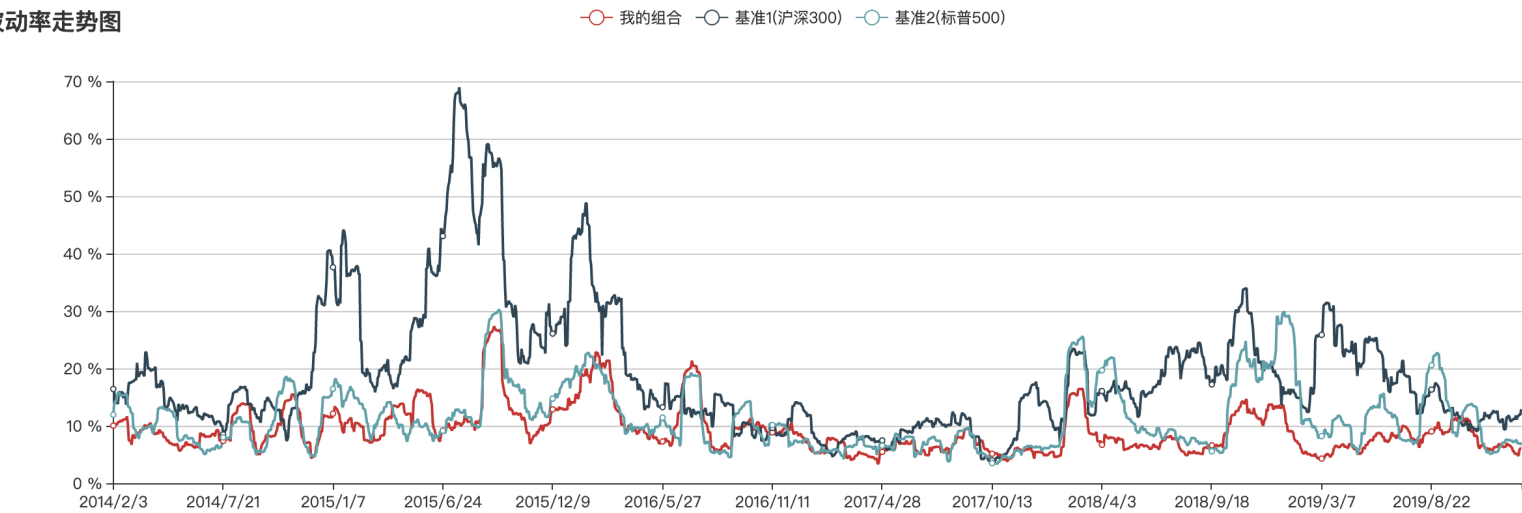
	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
2019年	21.49%	33.32%	24.42%
2018年	-7.01%	-28.3%	-7.6%
2017年	26.0%	27.15%	23.21%
2016年	12.39%	14.34%	24.7%
2015年	-11.63%	-15.4%	-13.33%
2014年	47.99%	50.05%	15.58%



业绩评价

	我的组合	基准1(沪深300)	基准2(标普500)
夏普比率	1.22	0.53	0.8
索提诺比率	1.7	0.73	1.11
斯图泽比率	3.62	3.46	2.93
卡玛比率	0.75	0.26	0.52

滚动年化波动率走势图



相关系数矩阵

	骏利亨德森遠見泛歐地產股票基金 A2類 Acc 歐元	柏瑞印度股票基金 A類 美元	安本標準 – 科技股票基金 A類 Acc 美元
股票基金 A2類 Acc 歐元	1	0.739	0.871
勻增長基金 A類 Acc 歐元	0.927	0.774	0.942
端印度股票基金 A類 美元	0.739	1	0.828
科學基金 A2類 Acc 美元	0.928	0.795	0.966
支股票基金 A類 Acc 美元	0.871	0.828	1



