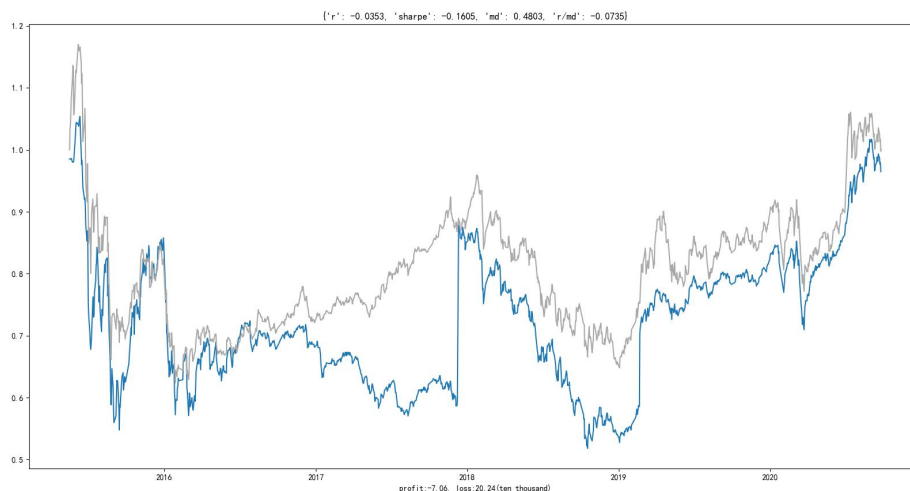


客户 C 基金检视报告（中风险版）

2020-09-25

一、真实历史交易复现：

复现周期：2015-05-18——2020-09-25



期间收益：-3.53% (-7.0 万元)

期间最大回撤：48.03% (20 万元)

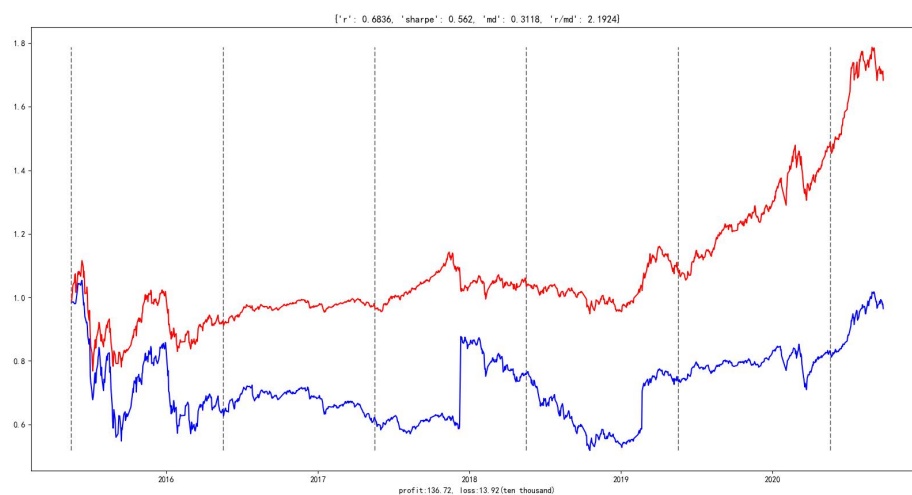
期间风险收益比：-0.07（即总收益/最大回撤）

二、组合化投资对比复现

持仓组合类别：中风险组合

投资方法：每次申购均买入对应季度的中风险组合，买入后每持有 12 个月调整一次

复现周期：2015-05-18——2020-09-25



期间收益：68.36%(137.0 万元)比原来提高了 1937.0%

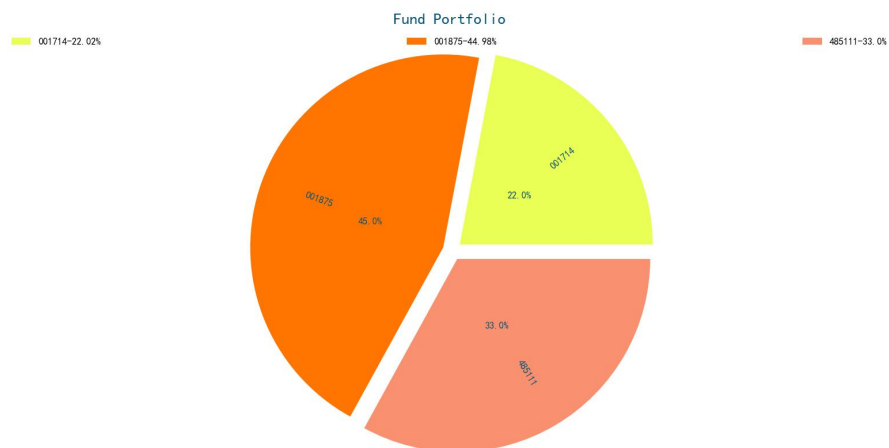
期间最大回撤：31.18%(14 万元)比原来降低了 35%

期间风险收益比：2.19（即总收益/最大回撤）比原来提高了 2983.0%

三、推荐基金组合

组合类别：中风险公募基金组合

组合更新时间：2020 年 3 季度（组合明细如下图所示）



组合明细（以 100 万元计算）：

001714 工银文体产业股票——22 万

001875 前海沪港深优势精选——45 万

485111 工银瑞信双利债券——33 万