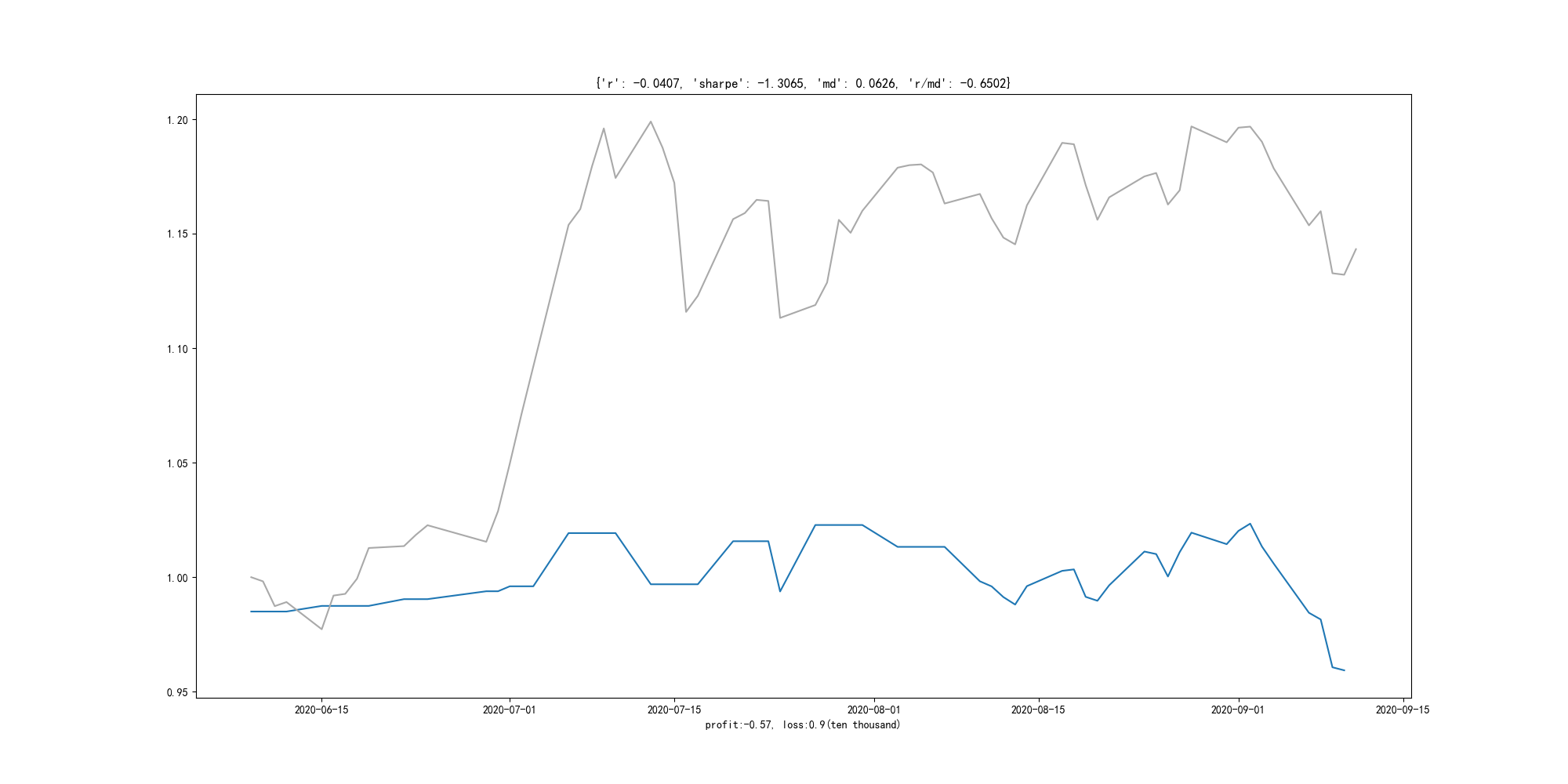
连云港分行\_buy基金检视报告（低风险版）

# 2020-09-13

# 一、真实历史交易复现：

复现周期：2020-06-09——2020-09-13



期间收益：-4.07%(-1.0万元)

期间最大回撤：6.26%(1万元)

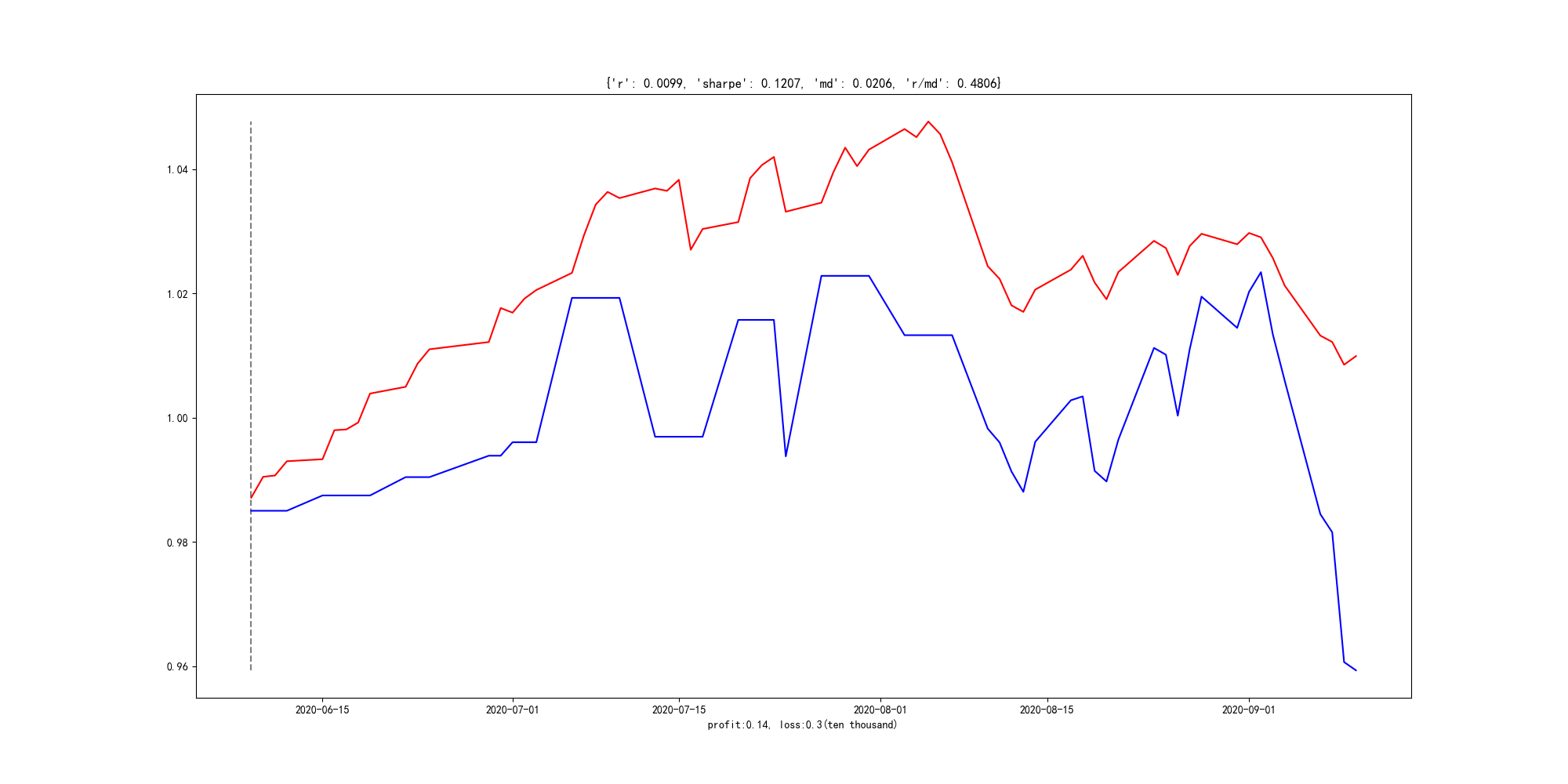
期间风险收益比：-0.65（即总收益/最大回撤）

# 二、组合化投资对比复现

持仓组合类别：低风险组合

投资方法：每次申购均买入对应季度的低风险组合，买入后每持有12个月调整一次

复现周期：2020-06-09——2020-09-13



期间收益：0.99%(0.0万元)比原来提高了24.0%

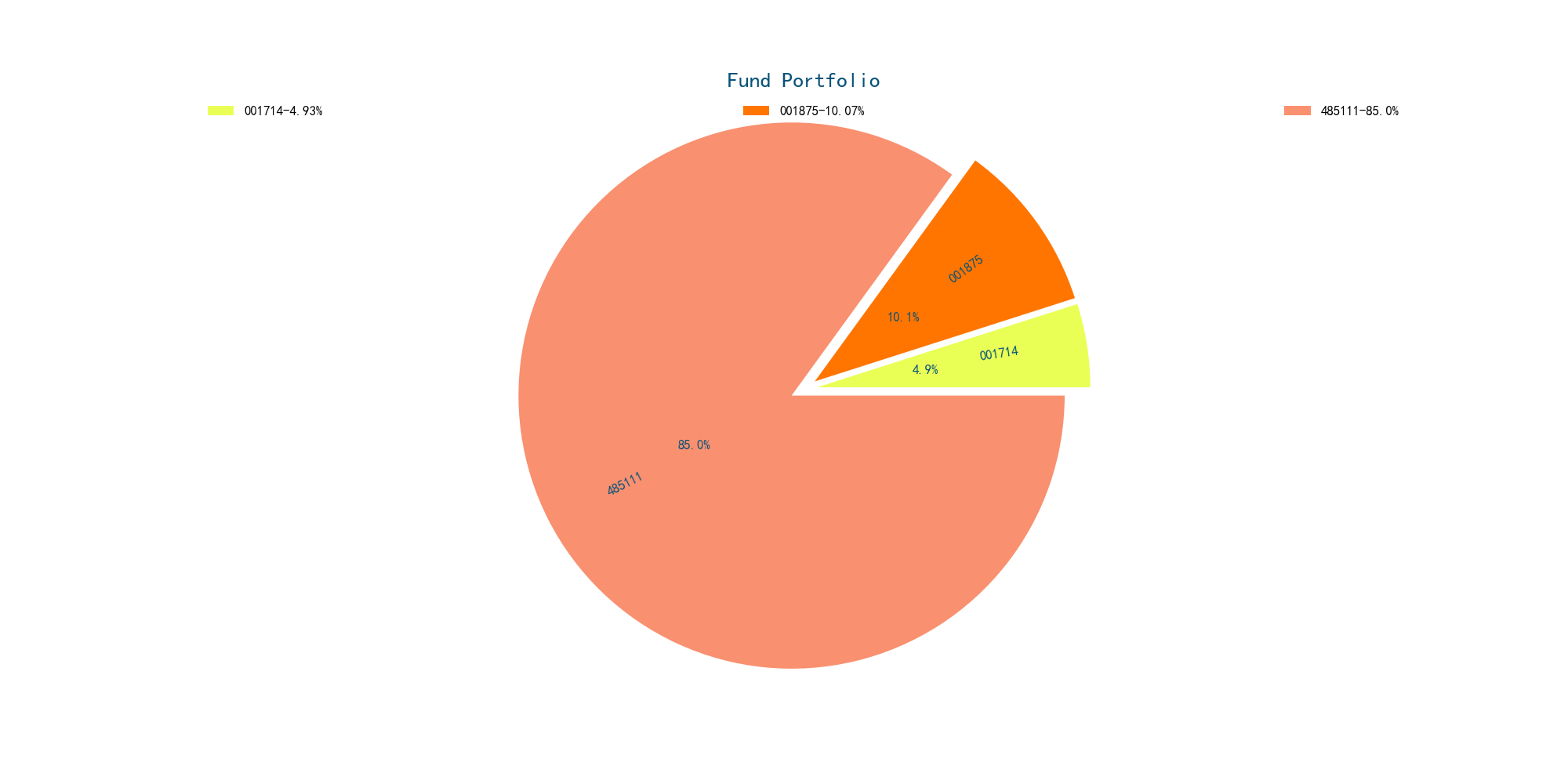
期间最大回撤：2.06%(0万元)比原来降低了67%

期间风险收益比：0.48（即总收益/最大回撤）比原来提高了74.0%

# 三、推荐基金组合

组合类别：低风险公募基金组合

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——5万

001875前海沪港深优势精选——10万

485111工银瑞信双利债券——85万