|  |
| --- |
| 基金简介 |
| 本FOF（Fund of Funds，基金中基金）产品通过短期投资于开放式股票型、混合型基金，获得显著优于沪深300指数的超额回报，能够在月度范围持续、较好地识别与选择基金，适合作为中长期持有的投资组合。  本产品在同一策略框架下，共提供4个选项，以迎合不同风险偏好。  资产类别  基金： 100% |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 收益概览 |  | 基金属性 | |
| |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | |  | 过去  1月 | 过去  3月 | 过去  6月 | 累计  收益 | 过去  一年 | 过去三年  （年化） | 过去五年  （年化） | 过去十年  （年化） | | 沪深300 | -7.78% | -15.86% | -12.64% | 142.38% | -28.52% | -3.35% | -2.62% | 4.52% | | Top 3 | -1.92% | -6.31% | 12.25% | 427.96% | -14.71% | 19.11% | 11.79% | 14.77% | | 超额 | 5.86% | 9.55% | 24.89% | 285.58% | 13.82% | 22.46% | 14.41% | 10.25% | | Top 5 | -1.89% | -8.27% | 11.65% | 411.64% | -15.71% | 22.14% | 13.83% | 14.75% | | 超额 | 5.90% | 7.59% | 24.29% | 269.25% | 12.81% | 25.50% | 16.45% | 10.23% | | Top 10 | -4.39% | -12.80% | 3.89% | 284.60% | -22.81% | 13.29% | 9.99% | 10.56% | | 超额 | 3.40% | 3.06% | 16.52% | 142.21% | 5.71% | 16.64% | 12.61% | 6.04% |   注：  过往业绩不代表未来业绩  超过12个月的回报率按年化收益计算  持仓采用“1/N”加权，每支基金在资产配置中占用资金量相等 |  | 起始时间  比较基准  主要市场 | 2012年1月  沪深300  A股市场 | |
| 基金选择 | |
| 基金池  基金类别  限制1  限制2  限制3  限制4  限制5  限制6 | 公募基金  股票型或混合型  非ETF、非QDII  上市超一年  股票占比>30%  自由申购赎回  规模>1亿人民币  优先选择C品种 | |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 净值表现 |  | 风险收益 |
| 注：  过往业绩不代表未来业绩  注：  沪深300行业权重选自2022年11月18日  本产品行业权重计算自2022年11月持仓（10月31日晚） |  | |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | |  | 收益率 | 波动率 | 夏普 | 贝塔 | | Top 3 | 14.77% | 24.60% | 0.60 | 0.93 | | Top 5 | 14.75% | 23.58% | 0.60 | 0.92 | | Top 10 | 10.56% | 23.02% | 0.45 | 0.93 |   注：  收益率、波动率、夏普（比率）均为年化值 | |
| 11月Top 3/5/10持仓 | |
| |  |  | | --- | --- | | 005094 | 万家臻选混合 | | 001858 | 建信鑫利灵活配置混合 | | 007193 | 恒越核心精选混合C | | 000584 | 新华鑫益灵活配置混合C | | 001997 | 工银新趋势灵活配置混合C | | 519089 | 新华优选成长混合 | | 206012 | 鹏华价值精选股票 | | 000308 | 建信创新中国混合 | | 002482 | 宝盈互联网沪港深混合 | | 005262 | 鑫元欣享灵活配置混合A |   注：  11月持仓计算自10月31日晚 | |