

敬呈

成龙 女

## 月度资产存续报告

Asset Statement Monthly Report



探普研究院  
TAMP research institute

飞度工作室

### 10月综述



探普研究院  
TAMP research institute

飞度工作室

成龙 女

客户年龄 42

客户风险偏好 平衡型

计划持仓 5年

#### 配置资金

计划配置金额: 2000.0 万元

现在配置金额为: 1800.0 万元

#### 收益情况

收益率: 6.06 % 20 %

中证500: 1000.00 万元

#### 最大回撤

最大回撤: 1.96 % 20 %

中证500: 1000.00 万元

#### 【月度回报表现】



## 【组合持仓】

截止日：最新净值日（2020-11-05）

投资策略	基金简称	份额确认时间	权重%	市值(万)	成本(万)	盈亏(万)	盈亏比(%)	盈亏贡献(%)
宏观策略	1.半夏宏观对冲	2020-07-29	16.21	324.91	200	124.91	62.46	12.43

## 【贡献分解】



# 探普研究院

## TAMP research institute

### 个基点评



探普研究院  
TAMP research institute

飞度工作室

### 远澜银杏1号

保留

- 1、该基金整体表现 **优秀/良好/一般/合格/较差**，收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，回撤控制能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，风险收益比例 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 2、在收益方面，该基金年化收益能力 **高于/持平/低于**，同类基金平均水平，有x%区间跑赢大盘/指数，绝对收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 3、在风险方面，该基金抵御风险能力优秀，在同类基金中处于中等水平，最大回撤为x%，低于同类基金平均水平；



探普研究院  
TAMP research institute

### 远澜银杏1号

保留

- 1、该基金整体表现 **优秀/良好/一般/合格/较差**，收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，回撤控制能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，风险收益比例 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 2、在收益方面，该基金年化收益能力 **高于/持平/低于**，同类基金平均水平，有x%区间跑赢大盘/指数，绝对收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 3、在风险方面，该基金抵御风险能力优秀，在同类基金中处于中等水平，最大回撤为x%，低于同类基金平均水平；



探普研究院  
TAMP research institute

### 远澜银杏1号

保留

- 1、该基金整体表现 **优秀/良好/一般/合格/较差**，收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，回撤控制能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，风险收益比例 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 2、在收益方面，该基金年化收益能力 **高于/持平/低于**，同类基金平均水平，有x%区间跑赢大盘/指数，绝对收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 3、在风险方面，该基金抵御风险能力优秀，在同类基金中处于中等水平，最大回撤为x%，低于同类基金平均水平；



探普研究院  
TAMP research institute

## 【调仓建议】

截止日：最新净值日（2020-11-05）

投资策略	基金简称	优化前(万元)	优化后(万元)
宏观策略	半夏宏观对冲	200	1000
	半夏宏观对冲	200	1000
	半夏宏观对冲	200	1000
总市值(万元)		1200	1000

## 【收益比较】



## 【相关性分析】

①	①	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56
②	0.56	②	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56
③	0.56	0.56	③	0.56	0.56	0.56	0.56
④	0.56	0.56	0.56	④	0.56	0.56	0.56
⑤	0.56	0.56	0.56	0.56	⑤	0.56	0.56
⑥	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56	⑥	0.56
⑦	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56	⑦

1.00 0.50 0.25 0.00 -0.25 -0.50 -1.00

- ① 基金名称1
- ② 基金名称2
- ③ 基金名称3
- ④ 基金名称4
- ⑤ 基金名称5
- ⑥ 基金名称6
- ⑦ 基金名称7

## 【指标对比】

截止日：最新净值日（2020-11-05）

类型	区间收益(%)	年化收益(%)	波动率(%)	最大回撤(%)	夏普比率
建议优化组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05
建议优化组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05
现有持仓组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05

注：以上指标自持仓首日开始计算，结果仅供参考，如果持仓时间过短会造成指标失真的情况。

## 总体点评

- 在保留综合性基金（富国创新，鹏华匠心，汇添富中盘）并增配中毅套利基金后，整体组合的波动率大幅降低，最大回撤从26%降到不足4%，年化收益提升1个点。

远澜银杏1号

- 1、该基金整体表现 **优秀/良好/一般/合格/较差**，收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，回撤控制能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，风险收益比例 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 2、在收益方面，该基金年化收益能力 **高于/持平/低于**，同类基金平均水平，有x%区间跑赢大盘/指数，绝对收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 3、在风险方面，该基金抵御风险能力优秀，在同类基金中处于中等水平，最大回撤为x%，低于同类基金平均水平；



10月综述 -- 优化组合建议

【调仓建议】

截止日：最新净值日（2020-11-05）

投资策略	基金简称	优化前(万元)	优化后(万元)
宏观策略	半夏宏观对冲	200	1000
	半夏宏观对冲	200	1000
	半夏宏观对冲	200	1000
总市值(万元)		1200	1000

【收益比较】



【相关性分析】



1.00 0.50 0.25 0.00 -0.25 -0.50 -1.00

- ① 基金名称1
- ② 基金名称2
- ③ 基金名称3
- ④ 基金名称4
- ⑤ 基金名称5
- ⑥ 基金名称6
- ⑦ 基金名称7

【指标对比】

截止日：最新净值日（2020-11-05）

类型	区间收益(%)	年化收益(%)	波动率(%)	最大回撤(%)	夏普比率

建议优化组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05
建议优化组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05
现有持仓组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05

注：以上指标自持仓首日开始计算，结果仅供参考，如果持仓时间过短会造成指标失真的情况。

## 总体点评

- 在保留综合性基金（富国创新，鹏华匠心，汇添富中盘）并增配申毅套利基金后，整体组合的波动率大幅降低，最大回撤从26%降到不足4%，年化收益提升1个点。

## 优化组合建议2 -- 新增基



探普研究院  
TAMP research institute

飞度工作室

### 远澜银杏1号

- 1、该基金整体表现 **优秀/良好/一般/合格/较差**，收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，回撤控制能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**，风险收益比例 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 2、在收益方面，该基金年化收益能力 **高于/持平/低于**，同类基金平均水平，有x%区间跑赢大盘/指数，绝对收益能力 **优秀/良好/一般/合格/较差**；
- 3、在风险方面，该基金抵御风险能力优秀，在同类基金中处于中等水平，最大回撤为x%，低于同类基金平均水平；



探普研究院  
TAMP research institute

## 新组合对比



探普研究院  
TAMP research institute

飞度工作室

### 【收益比较】



### 【指标对比】

截止日：最新净值日（2020-11-05）

类型	区间收益(%)	年化收益(%)	波动率(%)	最大回撤(%)	夏普比率
----	---------	---------	--------	---------	------

建议优化组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05
建议优化组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05
现有持仓组合	5.75	0.40	2.29	2.15	3.05

注：以上指标自持仓首日开始计算，结果仅供参考，如果持仓时间过短会造成指标失真的情况。

## 历史收益



探普研究院  
TAMP research institute

飞度工作室

### 【历史收益】

投资策略	基金简称	购入时间	购入成本(万元)	赎回时间	赎回金额(万元)	盈亏(万元)
宏观策略	组合	2020-07-29	25.81	2020-07-29	300	1004.87
	组合	2020-07-29	25.81	2020-07-29	300	1004.87
基金组合-刘先生	组合	2020-07-29	25.81	2020-07-29	300	1004.87

### 总体点评

- 在保留综合性基金（富国创新，鹏华匠心，汇添富中盘）并增配申毅套利基金后，整体组合的波动率大幅降低，最大回撤从26%降到不足4%，年化收益提升1个点。



探普研究院  
TAMP research institute

飞度工作室

我们挣的是角度和变化的钱，不是纠正市场错误的钱，市场永远是正确的，关键是在其正确被反复证明后的逆向，一定是避开它的正确被展开的过程。

——飞度



#### 探普研究院声明

本诊断报告所表述的任何观点均准确地反映了研究人员的看法；该研究人员所得报酬的任何组成部分无论是过去、现在、或者将来均不会直接或间接地与本报告所表述的建议或观点相联系。

#### 一般性声明

本报告对于收件人而言属于高度机密，只有收件人才能使用。本报告并非意图发送、发布给在当地法律或监管规则下不允许向其发送、发布该研究报告的人员。本研究报告仅供参考之用，在任何地区均不应被视为买卖任何证券、金融工具、基金、以及其他理

财产品的要约或要约邀请。探普研究院并不因收件人收到本报告而视其为客户。本报告所包含的观点及建议并未考虑个别客户的特殊状况、目标或需要，不应视为对特定客户关于特定证券或金融工具、基金、以及其他理财产品的购买建议或策略。对于本报告中提及的任何证券、金融工具、基金、以及其他理财产品，本报告的收件人须保持自身的独立判断。

本报告所载资料的来源被认为是可靠的，但探普研究院不保证其准确性或完整性，并不对使用本报告所包含的材料产生任何直接或间接损失或与此有关的其他损失承担任何责任。本报告提及的任何证券、金融工具、基金或其他理财产品均可能含有巨大的风险，可能不易变卖以及不适合所有的投资者。本报告所提及的证券、金融工具、基金或其他理财产品的价格、价值以及收益可能会受汇率影响而波动。过往的业绩也不能代表未来的表现。

本报告所载的资料、观点及预测分析均反映了探普研究院在最初报告发布日期当日的判断，可以在不发出通知的情况下做出更改，亦可因使用不同假设和标准、采用不同观点和分析方法而与市场上其他机构、部门、单位、个人在制作类似的其他材料时所给出的意见不同或者相反。探普研究院以及关联公司、单位并不承担提示本报告收件人注意该等材料的责任。负责撰写本报告研究人员薪酬并不基于任何金融产品的销售情况而定，但其薪酬可能会与我的整体收入有关。

若以探普研究院以外的机构或个人发送本报告，则由该机构或个人为此发送行为承担全部责任。该机构或个人应联系相关机构以交易本报告中提及的证券、金融工具、基金、其他理财产品获悉更详细信息。本报告不构成探普研究院向发送本报告的机构或个人的客户提供的投资建议，探普研究院以及关联单位、公司中的各个高级职员、董事、员工亦不为（前述机构或个人）因使用本报告或报告载明的内容产生的直接或间接损失承担任何责任。

**未经探普研究院事先书面授权，任何人不得以任何目的复制、发送或者销售本报告。探普研究院 2020 版权所有，保留一切权利。**