

投资绩效报告

2024-01-01 至 2026-07-02

金额单位 W

对比基准 沪深300ETF

01 核心结论

总盈亏金额

+93.13 W

扣除净入金后的投资结果

总收益率

+44.43 %

修正迪茨口径

最大回撤

10.3 %

2025-02-21 ~ 2025-04-08

交易主动收益

+66.78 W

对比期初持仓持有假设

账户收益为正：总收益率 44.43 %，总盈亏 93.13 W。净出入金 54.28 W 已从收益中剔除。

主要是价格涨跌带来的：价格波动 96.52 W；期间开平仓 7.18 W。

下跌需要留意：从高点最多回落 10.3 %（02-21至04-08），按一年折算，波动约 11.31 %；回落对应的收益补偿尚可。

顺势买入有效：买入集中在上涨趋势中，随后平均 8.32 %，本期顺势交易有效。

02 绩效与风险

期初 → 期末市值

179.92 W → 327.33 W

回撤期间

2025-02-21 ~ 2025-04-08

净入金

+54.28 W

夏普比率

1.22 优秀

年化收益率

+15.83 %

索提诺比率

1.56 良好

年化波动率

11.31 %

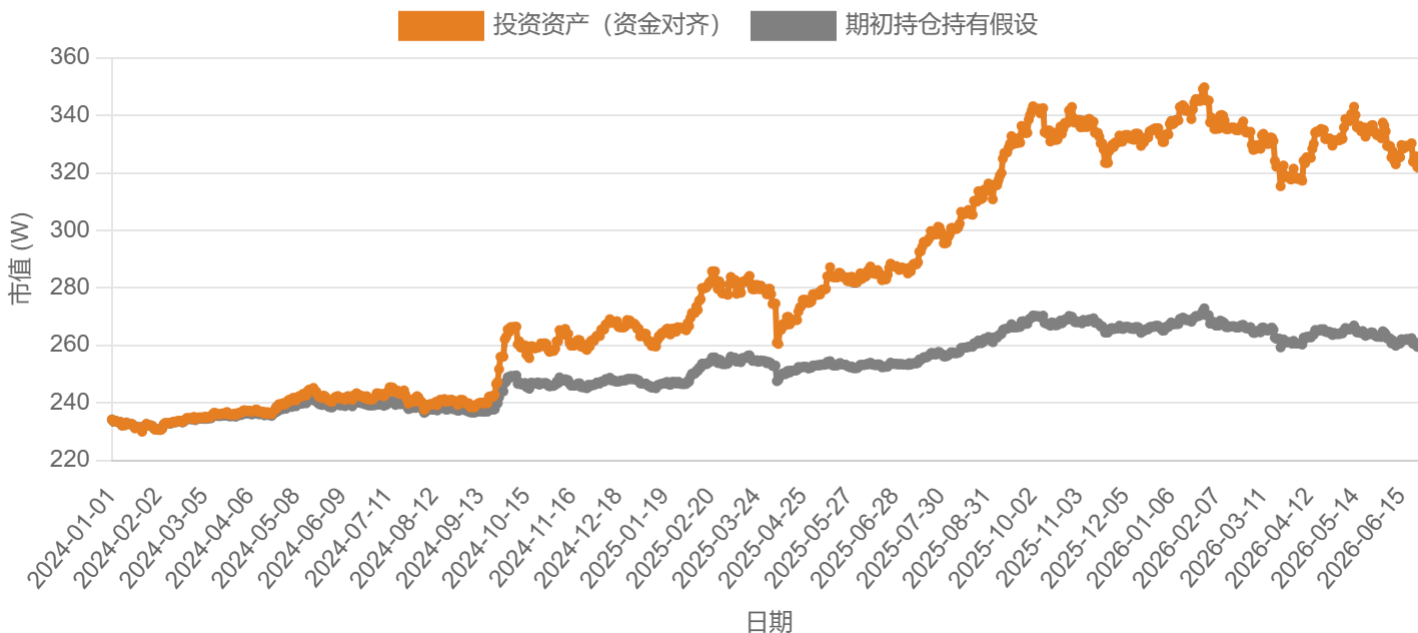
卡玛比率

1.53 良好

03 资产走势

本图展示：投资资产（资金对齐）、期初持仓持有假设。

投资资产走势



04 收益来源与交易表现

价格波动盈亏	+96.52 W	买卖交易次数 / 金额	233 笔 / 218.21 W
收入影响	+5.23 W	买入后回报	+33.17 %
交易执行影响	-1.33 W	卖出后回报	+9.72 %
汇率波动影响	-7.29 W	交易主动收益	+66.78 W

05 基准对比

组合 TWR +44.37 % 当前组合	基准 TWR +43.79 % 沪深300ETF	超额收益率 +0.57 % 组合 - 基准	相对胜率 40.74 % 按日收益率比较
----------------------------	--------------------------------	-----------------------------	----------------------------

本图展示：我的组合、基准。



- 跑赢基准且波动更低：收益超过基准，波动也更小，表现比较理想。
- 回撤比基准小：下跌阶段组合承受的压力更小。
- 这个参照比较合适：组合和基准走势相关性较高，适合作为主要参照。
- 多数时间落后基准：组合只有较少交易日跑赢基准，需要关注是否依赖少数日期。

06 口径说明

- 总收益率采用修正迪茨法，按资金进出发生时间加权，以减少出入金对收益率的扭曲。
- 交易主动收益以期初持仓持有到期末的假设结果为参照，衡量区间内买卖交易相对“不调仓”的影响。
- 收益来源中的收入影响包含现金分红、现金利息收入，以及融资、贷款或透支利息支出。
- 交易执行影响基于当日收盘价和成交结果对比，反映成交时点、成交价格、手续费和汇率差异带来的影响。
- 基准对比使用 TWR 口径，并统一换算为 CNY 后计算收益、回撤和波动。
- 统计准确性依赖交易记录与历史价格数据完整性，数据缺失可能导致结果失真。本报告不构成投资建议。

WealthSight 守护财务隐私，专注投资复盘。