

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - 回报 (百分比)

Returns	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	-0.027	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	0.0429	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	0.024	0.038	N/A	N/A
4/1/2014	0.021	0.089	N/A	N/A
5/1/2014	0.023	0.069	N/A	N/A
6/1/2014	0.031	0.076	0.117	N/A
7/1/2014	-0.029	0.023	0.115	N/A
8/1/2014	0.049	0.05	0.122	N/A
9/1/2014	-0.034	-0.016	0.058	N/A
10/1/2014	0.011	0.024	0.048	N/A
11/1/2014	0.046	0.02	0.0709	N/A
12/1/2014	0.018	0.075	0.058	0.181

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - 标准普尔回报 (百分比)

Benchmark Ret	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	-0.032	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	0.046	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	0.004	0.017	N/A	N/A
4/1/2014	0.012	0.062	N/A	N/A
5/1/2014	0.023	0.038	N/A	N/A
6/1/2014	0.016	0.0509	0.068	N/A
7/1/2014	-0.009	0.03	0.094	N/A
8/1/2014	0.04	0.047	0.0869	N/A
9/1/2014	-0.018	0.011	0.063	N/A
10/1/2014	0.028	0.049	0.081	N/A
11/1/2014	0.027	0.037	0.0859	N/A
12/1/2014	-0.008	0.048	0.06	0.133

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - alpha

Alpha	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	0	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	-0.003	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	0.021	0.024	N/A	N/A
4/1/2014	0.01	0.034	N/A	N/A
5/1/2014	0.004	0.036	N/A	N/A
6/1/2014	0.017	0.031	0.056	N/A
7/1/2014	-0.021	-0.003	0.031	N/A
8/1/2014	0.02	0.008	0.047	N/A
9/1/2014	-0.017	-0.027	0.001	N/A
10/1/2014	-0.019	-0.026	-0.031	N/A
11/1/2014	0.022	-0.018	-0.014	N/A
12/1/2014	0.025	0.028	-0.001	0.057

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - beta

Beta	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	0.855	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	0.979	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	0.79	0.879	N/A	N/A
4/1/2014	0.901	0.891	N/A	N/A
5/1/2014	0.826	0.849	N/A	N/A
6/1/2014	0.858	0.877	0.879	N/A
7/1/2014	0.935	0.901	0.896	N/A
8/1/2014	0.748	0.888	0.863	N/A
9/1/2014	0.946	0.92	0.902	N/A
10/1/2014	1.054	1.0069	0.978	N/A
11/1/2014	0.877	1.034	0.993	N/A
12/1/2014	0.931	0.997	0.977	0.934

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - 夏普系

Sharpe	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	-0.863	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	1.234	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	0.8149	0.685	N/A	N/A
4/1/2014	0.5659	1.562	N/A	N/A
5/1/2014	0.964	1.333	N/A	N/A
6/1/2014	1.731	1.641	1.617	N/A
7/1/2014	-1.015	0.559	1.622	N/A
8/1/2014	2.27	1.208	1.854	N/A
9/1/2014	-1.185	-0.3411	0.872	N/A
10/1/2014	0.168	0.328	0.5679	N/A
11/1/2014	2.525	0.2819	0.858	N/A
12/1/2014	0.384	0.95	0.62	1.529

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - 索丁诺系

Sortino	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	-1.129	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	4.0039	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	1.799	1.006	N/A	N/A
4/1/2014	0.702	2.281	N/A	N/A
5/1/2014	1.837	1.776	N/A	N/A
6/1/2014	4.088	2.182	2.164	N/A
7/1/2014	-1.406	0.782	2.312	N/A
8/1/2014	3.78	1.655	2.448	N/A
9/1/2014	-2.374	-0.498	1.17	N/A
10/1/2014	0.2839	0.43	0.719	N/A
11/1/2014	4.486	0.38	1.077	N/A
12/1/2014	0.837	1.623	0.845	1.985

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - 信息比率

Information Rati	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	0.098	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	-0.09	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	0.248	0.122	N/A	N/A
4/1/2014	0.16	0.1409	N/A	N/A
5/1/2014	0.001	0.1429	N/A	N/A
6/1/2014	0.297	0.138	0.13	N/A
7/1/2014	-0.365	-0.036	0.054	N/A
8/1/2014	0.136	0.017	0.084	N/A
9/1/2014	-0.272	-0.148	-0.013	N/A
10/1/2014	-0.149	-0.097	-0.071	N/A
11/1/2014	0.27	-0.064	-0.029	N/A
12/1/2014	0.29	0.097	-0.003	0.052

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - 波 性

Volatility	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	0.032	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	0.034	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	0.029	0.056	N/A	N/A
4/1/2014	0.036	0.057	N/A	N/A
5/1/2014	0.023	0.0509	N/A	N/A
6/1/2014	0.018	0.046	0.072	N/A
7/1/2014	0.029	0.042	0.0709	N/A
8/1/2014	0.022	0.041	0.066	N/A
9/1/2014	0.029	0.048	0.066	N/A
10/1/2014	0.063	0.073	0.084	N/A
11/1/2014	0.018	0.072	0.083	N/A
12/1/2014	0.046	0.079	0.093	0.117

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - 标准普尔波 性

Benchmark Vol	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	0.036	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	0.034	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	0.031	0.059	N/A	N/A
4/1/2014	0.038	0.059	N/A	N/A
5/1/2014	0.023	0.054	N/A	N/A
6/1/2014	0.017	0.047	0.075	N/A
7/1/2014	0.028	0.04	0.0709	N/A
8/1/2014	0.022	0.04	0.066	N/A
9/1/2014	0.027	0.045	0.065	N/A
10/1/2014	0.056	0.066	0.076	N/A
11/1/2014	0.012	0.063	0.074	N/A
12/1/2014	0.045	0.072	0.085	0.113

实例1:平衡宝在9个ETF上的表 - 最大回撤

Max Drawdown	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month
1/1/2014	3.30%	N/A	N/A	N/A
2/1/2014	0.80%	N/A	N/A	N/A
3/1/2014	2%	5.40%	N/A	N/A
4/1/2014	3.40%	3.40%	N/A	N/A
5/1/2014	1.70%	3.40%	N/A	N/A
6/1/2014	0.80%	3.40%	5.40%	N/A
7/1/2014	4.29%	4.29%	4.29%	N/A
8/1/2014	0.90%	4.60%	4.60%	N/A
9/1/2014	3.80%	4.60%	4.60%	N/A
10/1/2014	6.70%	11.50%	11.50%	N/A
11/1/2014	0.60%	11.40%	11.50%	N/A
12/1/2014	4.29%	6.70%	11.50%	11.50%