

基金动态

大摩华鑫强收益债基近期发行

记者日前从摩根士丹利华鑫(以下简称大摩华鑫)基金获悉,该公司旗下首只债券型基金——大摩华鑫强收益债券基金有望于近期发行。据悉,大摩华鑫强收益债券基金对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,还可以通过一级市场股票等参与权益类投资,投资于非固定收益类资产的比例不超过基金资产的20%,而持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

友邦华泰自投1200万元申购旗下基金

友邦华泰基金公司发布公告称,该公司于2009年11月12日通过代销机构申购友邦华泰价值增长(基金代码:460005,以下简称“友邦价值”)股票型基金1200万元。这是继友邦价值发行以来,该公司第二次运用自有资金申购该基金。友邦价值成立于2008年7月16日,截至2009年10月14日,基金份额净值达到1.4599元,已实现可分配收益近1亿元。2009年11月2日,该基金每10份基金份额分红3.1元。

建信沪深300指数基金成立

建信基金发布公告称,旗下首只指数型基金建信沪深300指数基金(LOF)按期结束募集工作并于日前成立,此次募集的净认购金额超过53亿元人民币。据了解,建信沪深300指数基金的募集成立,使今年以来成立的沪深300指数基金达到9只,加上往年成立的沪深300指数基金,目前市场上沪深300指数基金的规模已经超过千亿元门槛,成为指数型基金的主流产品之一。

本报综合报道

焦点关注

量化基金迎来投资元年

本报讯 11月11日,国内首只采用量化方法进行主动增强的指数基金,富国沪深300增强基金正式发行,沪深300基金首现“量化”概念。

记者获得的消息显示,目前还有多家基金公司的数只量化产品仍在申报中,量化投资基金产品及管理队伍的扩容步伐正在加快中。由此,今年也被业内称之为“量化基金投资元年”。那么,量化基金究竟有何优势?能否给投资者带来较好收益?投资者在选购量化基金时从哪里着手?

为此记者采访了富国基金另类投资部总监李笑薇女士。李笑薇女士曾任巴克莱大中华主动股票投资总监、高级基金经理,领导团队采用数量模型投资中国A股及泛亚洲市场。近日入选国家“千人计划”,成为公募基金领域唯一入选该计划的投资经理人。

问:量化投资在海外基金业现在是什么地位?

李笑薇:量化投资从1970年为零到现在举足轻重,到2009年大概已经占比达到30%以上,已经成为绝对的主流投资方法之一。

问:量化投资相比现在一般意义的主动投资有什么优势?

李笑薇:量化投资本身是通过模型把投资者的思想、经验、理念容纳在模型里面,通过模型结果来交易的,它的优势是,能够屏蔽市场交易时投资者的情绪波动问题。另外,电脑在数据广度上也有一定优势。处理大量的信息有优势。

问:定量投资的核心在什么地方?

李笑薇:定量投资的核心是模型设计,但真正的核心是模型中包含的投资理念。而不同的市场所适用的理念是不完全相同的。所以,不同的市场模型也不相同。比如美国、日本、欧洲、泛亚洲、中国A股的模型就“长”得非常不一样。

问:能否介绍下富国沪深300指数基金?

李笑薇:富国沪深300增强基金是首只沪深300基金中的量化概念,量化策略为沪深300产品增色不少。该产品以沪深300指数为跟踪标的,其股票投资比例不低于基金资产的90%,投资于沪深300指数成分股和备选成分股的资产不低于组合的80%,年跟踪误差严格控制在此7.75%之内。与传统产品不同,在跟踪指数的基础上,富国沪深300增强基金将利用富国定量投资模型进行主动增强。

据《经济参考报》

基金看市

南方基金

市场可能会走出跨年度行情

对于后市,南方深证成指ETF及其连接基金的拟任基金经理潘海宁认为,市场可能会走出一个跨年度的行情。自从今年8月份市场见到3500点左右出现20%左右的大幅度调整后,大盘在20%的牛熊分界线就出现了触底反弹,并且现在来看反弹的底部在逐渐提高,也稳步站在3000点以上。现在大家对经济复苏基本没有太大的分歧。随着欧美经济复苏,中国出口也会对明年中国经济增长带来贡献。经济复苏会持续支持我国股市的上涨,我们判断,三个月之内市场有望接近甚至创出前期反弹高点。

华商基金

四季度股市仍然比较乐观

华商动态阿尔法拟任基金经理梁永强表示,目前中国经济的各种矛盾在复杂的国际背景下,已经到了必须进行各种制度改革的关键时刻,国内经济内在变革带来的投资机会将是引导未来投资方向的重点。我们对四季度股市看法仍然比较乐观,看好积极进行产业升级和技术创新的企业,如新能源;看好地区均衡发展带来的消费升级;看好伴随老龄化而有着广阔增长前景的行业和企业,如健康医疗器械等。

本报综合报道

最新开放式基金净值

Table with columns: 基金名称, 最新净值, 累计净值, 日增长率, 周增长率, 月增长率, 涨跌幅. Lists various funds like 泰达领航精选, 友邦红利ETF, etc.

(2009年11月13日股市收盘后部分开放式基金净值,以上数据仅供参考,具体数据以基金公司公布净值为准。)

Advertisement for Tongtongyou (通通有) recruitment platform. Includes text: 招聘, 打造郑州强大专业的招聘、求职平台, 郑州晚报+通通有人才专刊+天骄人才网, 企业诚聘, 大型上市食品公司, 大型外资企业进驻河南, 郑州晚报分类广告部, 诚聘广告客户主任10名, 应聘电话: 63335000.

Advertisement for Tongtongyou (通通有) lifestyle information platform. Includes text: 生活资讯, 郑州最大的实用资讯互动平台, 分类广告最低9元全城最低, 报刊网互动传播全城独家, 医疗药品, 起名改名, 声明公告, 心理咨询, 郑州晚报分类广告部, 天天特价每行10元.