

一周资讯精粹（机构版）

二、【平安期货 2011 嘉理产品策略总结分析】

☆平安期货：“日内宝”嘉理资产 2011 程序化交易产品分析概览

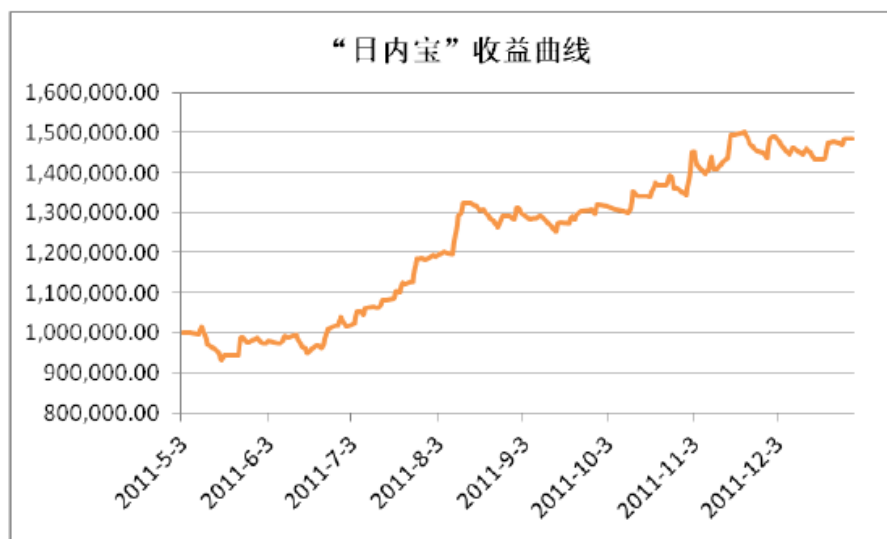
2012-1-4

嘉理资产管理公司成立于 1998 年，是首批在香港成立的另类投资公司之一。在开始运作时，嘉理主要管理合伙人的自有资金。自 2004 年以来，公司专注于亚洲市场特别是大中华区市场，现已成为拥有旗下一揽子基金的专业基金管理公司，管理资产在 2007 年已超过 10 亿美元，投资者包括来自欧洲、中东、亚洲及美国的银行、保险公司、组合基金 (fund of funds)、家族信托资产、非银行金融企业、民营企业以及高净值投资者等。

“日内宝”为嘉理基金研发的一款股指期货量化投资产品，产品由多个策略组合而成，具有良好风险收益比。长期以来，该产品获得了丰厚而稳定的回报，事实证明其能很好的适应复杂的市场环境。

“日内宝”交易绩效 (2011.5.1-2011.12.31):

日胜率: 62.87%; 实盘收益: 48.46%; 年化收益: 72.7%



产品特性	
投资标的:	沪深 300 股指期货
交易模式:	低频日内投机
核心交易策略:	短期趋势追踪: 从市场的日内盘中趋势获取利润
	短期趋势逆转: 根据专有定量模型决定建仓、出仓时机
交易方式:	程序化交易 (全自动)
产品风格:	稳健, 低风险, 只做日内交易
产品运行时间:	8 个月
实盘收益:	48.46% (2011.5.1-2011.12.31)