



FOR IMMEDIATE RELEASE

Contacts:

Hedge Fund Research, Inc.

Kenneth Heinz

Chicago/312.658.0955

info@hfr.com

[@HFRInc](https://twitter.com/HFRInc)

[@KennethJHeinz](https://twitter.com/KennethJHeinz)

MacMillan Communications

Mike MacMillan/Chris Sullivan

New York/212.473.4442

chris@macmillancom.com

CitySavvy

Henrietta Hirst

London/+44 (0) 20 3691 7560

henrietta@citysavvy.com

对冲基金，风险均衡策略 8 月业绩超过股市

宏观在 HFRI 业绩连续上涨的第十个月引领业绩上扬

HFRI 风险均衡指数发布的第一个月业绩上扬

芝加哥（2017 年 9 月 8 日）-根据全球对冲基金指数化，分析，和研究的领先机构 HFR 今天发布的数据显示，对冲基金和风险均衡策略在 8 月份业绩上扬，尽管围绕北韩局势日趋紧张，哈维飓风带来冲击，股票对冲和宏观策略引领 HFRI 进入连续第十个月的业绩上扬，过去 18 个月中有 17 个月业绩攀升。HFRI 基金权重综合指数 8 月份上涨+0.8%，年度业绩上升到+5.5%。8 月份的业绩超过道琼斯和标普 500 的略微上涨，也超过大多数发达欧洲国家股市，指数净值连续 9 个月创新高达到 13,662。

HFRI 资本权重综合指数 8 月份业绩也略微上扬+0.9%，年度业绩达到+4.5%。

HFRI 组合基金综合指数上升+1.2%，是自 2016 年 7 月一来最强劲的月度业绩。

新发布的 HFR 风险均衡指数业绩更为强劲，HFR 风险均衡波动 10 指数 8 月份业绩上扬+2.0%，年度业绩达到+8.9%。类似的，HFR 风险均衡波动 15 指数 8 月份上涨了+2.9%，年度业绩达到+12.8%。想了解更多的关于 HFR 风险均衡指数的信息，请访问 www.HedgeFundResearch.com。

尽管世界局势紧张和哈维飓风的影响，宏观策略基金在 8 月的业绩领先其它策略，HFRI 宏观（总）指数上涨+1.03%，领先的子策略包括大宗商品，量化顺势交易 CTA。

HFRI 宏观：大宗商品指数上涨了+1.0%，HFRI 宏观：系统性分散指数上涨了+1.4%。

HFRI 宏观指数（资本权重）8 月份上涨+1.2%。

股票对冲策略 8 月份业绩上扬，HFRI 股票对冲(总)指数上涨+0.96%，年度业绩截至 8 月份为+8.5%，年度业绩领先所有策略。股票对冲里面的子策略领先的是 HFRI 股票对冲：科技指数，上涨了+2.3%，年度业绩达到+12.5%。类似的，HFRI 股票对冲：医保指数上涨了+2.0%，年度业绩达到+12.9%。HFRI 股票对冲指数（资本权重）8 月份上涨了+1.6%。

固收为基础的相对价值套利基金 8 月份业绩上扬，HFRI 相对价值套利（总）指数上涨+0.3%，连续 18 个月业绩上扬。相对价值套利子策略中领先的是 HFRI 可抵押债券指数和 HFRI 相对价值套利：波动套利指数，分别在 8 月份上涨了+0.9%和+0.8%。

事件驱动策略 8 月份业绩略微上扬，HFRI 事件驱动（总）指数上涨了+0.03%，年度业绩达到+4.9%。事件驱动子策略中业绩领先的是 HFRI 事件驱动：特殊情形指数，8 月份上涨+0.7%，部分被 HFRI 事件驱动：激进交易指数业绩-2.1%下滑所冲销。

“对冲基金在 8 月份受到股票和顺势交易策略的业绩提升，月中曾经因为北韩局势紧张的升级，以及哈维飓风对能源和大宗商品为中心的冲击而市场波动上升，” Kenneth J. Heinz, HFR 总裁说，“尽管利率有小幅改变，股市业绩也比较错综，风险均衡策略 8 月份业绩上扬，彰显出该策略在机构投资者投资组合中的重要地位。随着在 2017 年下半年国内，国际政策风险和不确定性的持续，包括税收改革立法，可能的军事冲突，以及现在持续的自然灾害冲击，对冲基金和风险均衡策略将持续成为机构投资者有价值的策略性投资选择。”

 Follow HFR on Twitter: @HFRInc

 Follow Ken Heinz on Twitter: @KennethJHeinz

Follow HFR on Weibo: @HFRAsia

About HFR®

HFR (Hedge Fund Research, Inc.) is the global leader in the alternative investment industry, specializing in the indexation and analysis of hedge funds. Established in 1992, HFR produces the HFRI, HFRX and HFRU Indices, the industry's most widely used benchmarks of global hedge fund performance. HFR calculates over 100 indices of hedge fund performance ranging from industry-aggregate levels down to specific, niche areas of sub-strategy and regional investment focus. HFR Database, a comprehensive resource available for hedge fund investors, includes fund-level detail on historical performance and assets, as well as firm characteristics on both the broadest and most influential hedge fund managers. HFR has developed a detailed fund classification system, enabling granular and specific queries for relative performance measurement, peer group analysis and benchmarking. The HFR suite of analysis products leverages HFR Database to provide detailed, current, comprehensive and relevant aggregate reference points on all facets of the hedge fund industry. HFR also offers consulting services for clients seeking customized top-level or more sophisticated analysis. For the hedge fund industry's leading investors and hedge fund managers, **Hedge Fund Research is The Institutional Standard.**

###