




FOR IMMEDIATE RELEASE

Contacts:

HFR

Kenneth Heinz
Chicago/312.658.0955
info@hfr.com  @HFRInc
@KennethJHeinz

MacMillan Communications

Chris Sullivan
New York/212.473.4442
chris@macmillancom.com

Hydra Strategy

Henrietta Hirst
London/+44 (0) 7880 742 375
Henrietta.hirst@hydrastrategy.co.uk

随着美国大选揭晓，疫苗开发前景乐观，对冲基金业绩上扬

***HFRI500 月度业绩上涨接近纪录；
股票对冲，事件驱动引领广泛的策略业绩上扬；
HFR 区块链，加密货币指数随着比特币价格上涨而上涨；
安本标准投资 (ASI) 开始为新基金平台融资，包括 HFRI500 跟踪基金***

芝加哥（2020年12月7号）-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，HFRI 500 指数在 11 月份业绩上扬，为历史第二高的月度业绩，主要受到美国大选揭晓和对多种新冠疫苗开发前景的乐观预测。可投资的 HFRI 500 基金权重指数该月上涨+4.6%，年度业绩上升到+5.6%。HFRI 基金权重综合指数 11 月份上涨+6.2%，是自 1999 年 12 月以来最强的月度业绩，也是该指数自 1990 年成立以来第二强的月度业绩。

这仅次于记录的月度业绩主要受到股票对冲策略的驱动，该月全球股市都出现正向的上扬。HFRI 股票对冲（总）指数该月上涨+8.7%，自 2000 年二月份以来的最强月，而 HFRI500 股票对冲指数上涨+7.5%，是成立以来最强月度业绩。股票对冲的业绩受益于旗下几乎所有的子策略，可投资的 HFRI 500 股票对冲：基本面增长指数上涨+9.9%，HFRI 股票对冲：基本面价值指数上涨+10.1%。HFRI 股票对冲：量化方向性指数该月上涨+10.6%，而 HFRI 股票对冲：复合子策略指数上涨+10.3%。

事件驱动策略在 11 月业绩也上扬，主要受益于股东权益交易，特殊情形，并购套利，以及不良债重组子策略。HFRI 事件驱动（总）指数该月上涨+7.6%，超过 1999 年四月的+5.1%的最高月度业绩，而可投资的 HFRI 500 事件驱动指数上涨了+5.9%。股东权益交易指数上涨+11.0%，

HFRI 事件驱动：特殊情形指数上涨+9.8%。可投资的 HFRI 500 事件驱动：并购套利指数和 HFRI 事件驱动：不良债指数都上涨了+6.7%。

区块链和加密货币敞口也驱动市场的上涨，对冲基金持续在新的和现有策略中扩大相应的敞口。HFR 区块链指数 11 月份上涨+53.4%，年度业绩上涨到+159.2%，而 HFR 加密货币指数该月上涨+57.2%。

风险溢价，风险平价和流动另类资产在 11 月份业绩也表现强劲，主要受到信用和股票敞口的影响。HFR 银行系统性风险溢价信用指数该月上涨+40.5%，其中领先的是多策略信用子策略。HFR 风险平价波动率 12 机构指数 11 月份上涨+8.4%，使得年度业绩达到+5.6%。HFRI-I 流动另类 UCTIS 指数该月上涨+2.8%，其中业绩领先的是 HFRI-I UCITS 股票对冲指数，上涨了+3.9%。

HFRI 相对价值套利（总）指数该月上涨+4.2%，而可投资的 HFRI 500 相对价值套利指数上涨了+3.2%。相对价值套利中业绩领先的是 HFRI 相对价值套利：收益另类指数，上涨了+20.7%，而可投资的 HFRI 500 相对价值套利：可转债套利指数上涨+3.2%。

与市场不相关的宏观策略该月随着股市和加密货币上涨而上涨，HFRI 宏观（总）指数上涨+1.3%，而 HFRI500 宏观指数上涨了+1.1%。宏观子策略中业绩领先的是基本面策略，HFRI 宏观人为决策指数上涨+2.9%，而 HFRI 宏观：系统性分散/CTA 指数上涨+1.9%。


安本标准投资开始为创新的新基金平台融资

安本标准投资（ASI）开始为它的创新新基金平台融资，该平台是业内第一个利用传统的被动投资方法来投资对冲基金的平台。为了让平台尽早面世，ASI HFRI 500 指数基金将在 2021 年 5 月前筹集 5 亿美金，主要目标资金来源于机构投资者。这个基金将会跟踪 HFR 500 指数，该指数由 500 支涵盖业绩最宽泛的策略基金构成，可投资的容量超过 500 亿美金。这个项目目标是在 ASI 的指数跟踪平台上发布一系列的产品，这些产品让 ASI 通过直接投资到指数成分基金来跟踪一系列的可投资对冲基金指数。

“HFR 很高兴能支持对冲基金市场具有划时代意义的进步。第一次投资人能够通过一系列的指数跟踪基金来投资 HFRI 基准指数”，HFR 主席和创始人，乔瑟夫·尼古拉斯说，“旗舰的 HFRI500 指数是一个全球，平均权重的指数，由汇报给 HFR 数据库的最大型基金组成，这些基金向新投资人开放，具有季度或者比季度更短的流动性。它为客户提供代表性的对冲基金市场回报基准，同时允许跟踪产品能通过投资业内最著名的基金得到广泛，分散的对冲基金策略回报。”

“对冲基金在不同的策略在 11 月份都出现创纪录的上涨，主要领先的领域包括股票对冲，事件驱动和加密货币，这主要受到美国大选不确定性的下降和新冠疫苗开发前景的乐观估计，” Kenneth J. Heinz，HFR 总裁说，“2020 年主要由强劲的和波动的宏观经济和地缘政治趋势所主导，机构投资者持续增加在对冲基金和其他另类产品的资产配置，构建强劲的业绩惯性，建仓来迎接 2020 年业绩上涨的加速。”

 Follow HFR on Twitter: @HFRInc

 Follow Ken Heinz on Twitter: @KennethJHeinz

Follow HFR on Weibo: @HFRAsia

About HFR®

HFR 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, **HFR is The Institutional Standard.**

###