

2015年11月20日发布

Table with 2 columns: 目前结果, 收益/损失. Rows include VE Forecast 16 LONGS, VE Forecast 16 SHORTS, Portfolio Total, S&P 500, and Excess Gain/Loss.

Table with 6 columns: 标准策略, 偏多, 中性, 偏空. Rows include No Stops and 50/50 Allocation.

Table with 6 columns: 修订策略, 偏多, X, 偏空. Rows include Stopped Out (10%/10%) and 60/40 Allocation.

分析

对于10月/11月, 市场继续从八月的大跌反弹, 标准普尔500指数获得了相当不错的收益... 3.09%, 我们的投资组合的同期表现则更为优异, 回报接近15%...

十月/十一月 投资组合

上月多头业绩

Table with 7 columns: 股票代码, 公司名称, 买入价 2015. 10. 22, 现价, 变动, 波幅%, 板块. Includes rows for ALDW, AXL, BFR, BIP, BRSS, GFF, HELE, LCI, MIK, SPR, STRZA, TMHC, TNK, TSE, TSEM, WU, LONG PORTFOLIO, and GSPC S&P500.

十月/十一月 投资组合

上月空头业绩

Table with 7 columns: 股票代码, 公司名称, 买入价 2015. 10. 22, 现价, 变动, 波幅%, 板块. Includes rows for AIR, ARWR, ATI, CKEC, ENOC, FTR, FUEL, LFL, LXU, MCF, OCN, PRIM, SHLD, SNAK, TSLA, XONE, SHORT PORTFOLIO, and GSPC S&P500.

十一月/十二月 投资组合

下月多头新增及保留持仓

Table with 9 columns: 股票代码, 公司名称, 市价, 估值, 过去12个月收益, 一月预期收益, 一年预期收益, 市盈率, 板块. Includes rows for ALDW, AXL, BFR, BIP, BRSS, CALM, GFF, HW, HZNP, OUTR, SPR, TA, TNP, TSE, TSEM, WU.

注: 加粗字体表示新增持仓。
小结, 本月我们会卖出: HELE, LCI, MIK, STRZA, TMHC和TNK
同时买入: CALM, HW, HZNP, OUTR, TA和TNP

十一月/十二月 投资组合

下月空头新增及保留持仓

Table with 9 columns: 股票代码, 公司名称, 市价, 估值, 过去12个月收益, 一月预期收益, 一年预期收益, 市盈率, 板块. Includes rows for AAVL, AIR, CX, CZR, ENOC, FUEL, LFL, LXU, MCF, NAV, OCN, SHLD, SNAK, TERP, TROX, XONE.

注: 加粗字体表示新增持仓。
小结, 本月我们会平仓: ARWR, ATI, CKEC, FTR, PRIM 和TSLA
同时卖空: AAVL, CX, CZR, NAV, TERP和 TROX

为什么采取市场中性的投资策略?

市场中性投资策略以绝对回报换取较低价格波动, 达成长期的稳定回报。实质上, 使用市场中性策略就如同操作您个人的对冲基金一样, 但省去了对冲基金收取的高额管理费及业绩提成...

如何使用本投资组合

您需要认真研究所选股票的红利发放时间, 企业兼并, 股票拆分, 公司活动, 美国证券交易委员会行为, “天灾”等信息, ValuEngine的专有模型无法充分反应上述事件对投资组合收益的影响...

我们的研发程序对ValuEngine预测模型的不同资产规模与配置方式进行了反覆测试。通常, 每一支股票的投资权重相同, 且每月进行重新配置。但是, 您可根据您对市场多空的想法调整投资组合, 达到灵活配置。

如果您想节省交易成本, 请不要将您原有的仓位平仓, 您应该保留备选方案列表或是当月推荐列表中的股票。这些被认为应保留的股票均是当月所在板块的前三名...

VALUENGINE的方法论

ValuEngine的研究是结合了最先进的学术概念和华尔街的现实做法, 得出的最先进的市场公允价值和价格预测技术。

ValuEngine的股票估值采用了先进的三因素方法。基本变量, 如公司过去12个月的每股收益(EPS); 分析师对公司未来12个月每股收益的普遍预期; 以及30年期国债收益率等因素都被用来更准确地反映公司的公允价值。

ValuEngine的股票预测考察每个行业六个月时间区间内的短期价格逆转、中期趋势延续、长期价格逆转等因素, 以确保预测是基于恰当的参照系, 并采用先进的统计/经济学技术...

ValuEngine 评级是对个股的整体吸引力进行的评估。评级综合了估值、风险-收益权衡、动能、实质和预期未来收益。仅有2%的个股被赋予最高评级——ValuEngine 5级。最低评级是1。

有关 ValuEngine模型及业绩等信息, 请登陆 www.valuengine.com

现在开户, 立享:

- 交易佣金低至\$3*
全方位24小时中文服务
先进的美股及期权交易平台
高达一亿五千万的帐户保险
完善的中文研究

开户100笔 免佣金交易**
现在就开户!
转帐户可免费获得高达100美元过户补偿费**
推荐朋友获25笔免交易佣金

SogoTrade 目前网络证券交易基础佣金是\$5/笔, 过去3个月平均每月交易次数达50次或以上的客户, 每笔股票交易佣金将降至\$3。

披露: ValuEngine为投资者提供资产投资建议和相关投资收益的估计, 采用买入-持有-卖出三级评级系统, 这是该公司的五级评级系统的简化版本...

披露声明: 以下评级用来评价股票的12个月预期表现: 买入: 预计跑赢标准500, 产生高于平均水平的回报...

免责声明: 本报告仅供参考, 不构成或承担任何投资或投资建议, 本报告亦不构成具体的投资建议、财务状况以及具体投资者的特殊需求...