

量化投资“领头羊”带领团队赢“金牛”

李笑薇(富国基金管理有限公司总经理助理、量化与海外投资部总经理、基金经理)

金融人·中国梦
金融海归的追梦之路
市金融党委 新民晚报社
联合推出

“千人计划”促成回国发展

我的工作领域是金融,更具体来说是公募基金中的量化投资。公募基金利润的源泉是上市公司在市场上的错误定价。为了找到真实定价,公募基金大量地收集并挖掘信息,监督上市公司行为,使之更加透明和规范。一个透明规范的二级市场一方面帮助企业融资成长,另一方面帮助小投资者和普通老百姓分享好的企业成长带来的财富积累。因此,我们的具体工作有着积极的社会意义。

4年前,量化投资在国内几乎是空白。由于专业门槛较高,本土自学成才也相对困难。即使在国外,拥有量化投资核心技术的也仅限于国际大型金融集团的某些部门。而另一方面,当时国内很多人认为在中国数据造假严重,赚钱要靠资源人脉、甚至内幕消息,对于量化投资这种依赖公开数据的投资方式持怀疑态度。因此,基金行业要想推动这个业务领域的发展,求洋经、引进海外人才几乎是必经之路。

2008年底,上海金融系统组织的美国招聘会触动了我回国的念头。中央和上海市“千人计划”,让我看到了国内对人才的高度重视,这更坚定了我回国的决心。于是,2009年,我成为了中国资本市场大发展中的一员。

带领团队实现几次产品创新

当时国内基金公司中基本上没有专门的量化投资部门,我回国后的首要任务是组建



富国基金公司量化投资部,这是国内基金公司中最早建立的量化投资部之一。由于我的工作领域在国内的发展刚刚起步,我有机会带领团队在不到三年的时间里实现了几次产品的创新。

2009年底,我们给投资人提供了市场上第一支采用“主动量化”方法进行增强的指数增强基金。由于技术上的优势以及对投资人需求的精准把握,这支基金在市场上的定位具有唯一性,也获得了投资人的认同,并在2011年获得了行业公认最具权威的中国基金

业金牛奖。

助推新的投资方式进入中国

和其他领域一样,人才是金融领域不可或缺的重要资源。回国之后,本着培养本土人才和节约成本的原则,我在团队创建过程中尽量发掘使用本土有潜力的年轻人。截至目前量化投资团队中除我之外全部是本土教育、本土经验培养起来的年轻人才。而受益于“千人计划”的我,也很荣幸有机会成为千人计划联谊会金融专业委员会的负责人之一,

人物自述

能够学有所成并能学以致用,是一种幸福。而通过自己的工作,正面影响一部分人的生活,则是我的简单梦想。开放的环境,让我有机会从中国的顶尖学府一路学到美国的顶尖学校,又从顶尖的国际大型金融集团一路积累实战经验到领军带队。人到中年之际,恰逢“千人计划”,让我能够带着经验,携着幼子和思乡之情,回到生养自己的土地,来圆这一个中国梦。

记者问答

问:上海建设国际金融中心,你觉得最有竞争力的地方是什么?
李:最有竞争力的是比较公平、规范和市场化了的竞争机制;其次是比较国际化的教育和医疗资源。
问:在你看来,上海国际金融中心建设想要吸引更多海外金融人才,最核心的应该从哪方面着力?
李:制度建设,更加公平、规范和市场化。
问:关于梦想,你的人生格言是什么?
李:用自己的努力和工作给社会

中一部分人带来正能量便已足够。
问:您最想对金融系统青年员工说的一句话是什么?
李:目前在中国的金融行业工作是幸运的。行业处在发展初期,同等的努力在金融行业有可能获得比其他行业更多的回报。勤恳工作,知恩感恩,将帮助我们通向事业与人生的成功。
问:你对自己未来的工作和生活,还有哪些新的期待?
李:随着行业进步,做更多有益的工作。

为金融行业的海归专家服务,对整个行业有所回馈。

说到底,我只是一个普通的金融从业人员,这个时代给了我太多机会和荣誉。我很庆幸自己的具体工作能够助力推动一种较新的投资方式进入中国市场,丰富市场中的研究分析手段,促进市场的公平有效,并帮助普通投资人分享成功上市企业带来的财富积累。我希望看到量化投资在中国市场上的成功,哪怕使它成功的人不是我。

本报记者 鲁雁南 整理

220家跨国公司总部落户浦东

陆家嘴成为全球资源配置新高地

陆家嘴,作为上海的地标之一,不只是金融业一枝独秀,也正成为越来越多全球跨国公司地区总部的首选地。

浦东新区商务委近日推出的《2013上海市浦东新区跨国公司地区总部发展蓝皮书》显示,陆家嘴金融贸易区和世博地区在浦东的总部发展空间和功能定位中位于第一层次,是总部经济核心区域,在建或待建总部楼宇32栋,已规划待开发12.75万平方米土地可作为总部用地,陆家嘴总部经济发展潜力无限。

顺应客户需求

总部在瑞士的泛亚班拿集团是全球首屈一指的供应链解决方案供应商。集团将其核心业务——空运、海运和物流融合,以提供全球综合订制的门到门解决方案。泛亚班拿在全球货代行业位居第四,在全球70多个国家拥有500多个站点的巨型物流网络,其业务拓展进入中国38年,在中国区已拥有20个站点,而统筹这些中国站点运营的总部就设在上海小陆家嘴核心区域。2010年开始,公司正式决定将中国区总部搬到陆家嘴。泛亚班拿中国区高级副总裁费瑞将这个决策的重要因素总结为“紧跟大客户需求”。

费瑞是一位海运专家,他介绍,选择上海设立总部是因为这里是中国的航运中心,上海港的年集装箱吞吐量已经超过3370万标箱,位居世界第一,最贴近客户市场,是最重要的决策中心;选择陆家嘴是因为这里是成长最快的金融中心,航运更需要金融的支撑。他透露,早在自贸试验区成立前,泛亚班拿已经在自贸试验区注册了一家企业,便于公司在保税区开展仓储业务。如今借了自贸试验区的“东风”,公司的跨境业务有了更多

便利。该公司中国区财务总监陈平平介绍,公司目前正与其欧洲一家客户研究通过香港方面的境外人民币账户开展跨境结算,试点收付汇集中结算,此举可帮助公司提高资金运行效率,节约财务成本。

费瑞选择居住在陆家嘴,他说,“上海的天际线在浦东,陆家嘴是最能代表上海的区域之一,所以尽管陆家嘴租金不菲,但公司还是选择将中国总部放在陆家嘴,这也是顺应服务重要客户群的需求。”

吸引新兴行业

除了金融、航运这样的行业巨头青睐陆家嘴,一些新兴、小众产业也选择在陆家嘴安家。必维国际检验集团(以下简称“必维集团”)是一家跨国公司,集团年营业额逾39亿欧元,作为国际三大检测机构之一,同样将中国区总部设在陆家嘴。

“大楼能经得起时间的考验吗?是否达到国际环保标准?消费品是否达到国际最高质量标准,确保今后无安全隐患?”这样的疑问可以通过国际专业机构的检测和技术支持,得到回答和验证。这样的新兴产业在全球范围内已经非常成熟,在中国“小荷才露尖尖角”,但前景无限。

大中华区市场与销售总监李文江是名“上海女婿”,到法国留学后被必维集团派驻中国拓展市场,必维集团在中国区的业务一方面是帮助国内企业做第三方检验、认证,包括产品出口认证;另一方面是服务进入中国市场的外资企业,无论其在中国何处开展项目,在资产或产品的整个生命周期内,必维集团都将协助其降低风险、提高业绩。

李文江说到必维和陆家嘴结缘的原因,

他表示,开始时候公司选择在浦西,但随着公司大量业务拓展到浦东,总部也“东迁”。公司在上海揽下的大项目包括2010年上海世博会12座国家馆的项目管理、技术支持服务,东海大桥风电场的并网发电项目检验、评估服务,上海电气火电机组出口到印度的项目认证、审核服务,以及公司正在全力投入的上海大型主题乐园工程项目管理服务,都是“浦东项目”。

提升市场地位

据统计,截至今年6月底,浦东累计落户跨国公司地区总部220家,约占全市47%,近半壁江山。《2013上海市浦东新区跨国公司地区总部发展蓝皮书》显示,陆家嘴金融贸易区和世博地区在浦东的总部发展空间和功能定位中位于第一层次,是总部经济核心区域,在建或待建总部楼宇32栋,已规划待开发12.75万平方米土地可作为总部用地,总部经济在陆家嘴仍有充分潜力可挖。

记者从陆家嘴金融贸易区管委会获悉,截至今年6月底,陆家嘴累计引进300多家具有总部特征的功能性机构,其中跨国公司地区总部企业86家、投资性公司39家、管理性公司47家。

总部集聚提升了陆家嘴在全球资源配置中的市场地位,跨国公司地区总部选择“扎根”陆家嘴,也为公司下一步战略发展提前“落子”。国内知名的瑞华会计师事务所,早在2010年(当时名为中瑞岳华)迁到陆家嘴保险大厦办公,如今又将目光投向还未竣工的上海中心大厦。事务所合伙人、管委会委员连向阳说,“尽管搬到陆家嘴后,成本更高,但宁可多付一点租金,也要锁定高端客户。”

本报记者 宋宁华



最高“爱情邮局”亮相金茂大厦

2014——这个浪漫的年度,爱人和情侣们又有了一个新去处,那就是位于金茂大厦的世界最高爱情主题邮局。昨天,2014集邮文化季暨“情比金坚”金茂大厦爱情邮局启动仪式在金茂大厦88层观光厅拉开序幕。

启动仪式由中国金茂(集团)有限公司、上海市集邮总公司共同举办、上海市邮政公司浦东新区分公司协办。据悉,“空中爱情邮局”里设计了爱情合影区、情感纪念墙、纪念邮戳专区3个部分。金茂大厦88层观光厅还特别推出《永恒的爱》婚庆个性化邮票定制服务及爱情纪念邮戳加盖服务。活动当天,有多对新婚证证夫妻携双方亲人参观金茂大厦88层观光厅,并现场参与“爱情宣誓”及“幸福传递”活动。

本报记者 宋宁华
实习生 胡嘉俊 摄影报道