

第一创业期货-睿博 11 号资产管理计划 2018 年第 3 月份报告

(2018 年 3 月 01 日—2018 年 3 月 31 日)

第一节重要提示

本报告由资产管理计划管理人编制。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。

资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2018 年 3 月 01 日至 2018 年 3 月 31 日。

第二节重要提示

名称	第一创业期货-睿博 11 号资产管理计划
类型	封闭运作
成立日	2017 年 11 月 8 日
报告期末份额总额	6,000,000.00 份
投资目标	在有效控制投资风险的基础上，追求资产的稳健增值。
投资策略	同时构建股票多头组合和股指期货空头组合，对冲风险，稳健收益
风险收益特征	本计划产品份额具有 R3 等级风险特征。
管理人	第一创业期货有限责任公司
托管人	中泰证券股份有限公司
注册登记机构	第一创业证券股份有限公司

第三节资产管理计划主要财务指标和业绩表现

(单位：人民币元)

本计划期末净收益	33,643.31
期末计划资产净值	6,033,643.31



第四节 管理人报告

一、投资经理简介

张童，本科毕业于四川大学计算机科学与技术、国际经济与贸易专业，工学、经济学双学士；研究生毕业于中国人民大学金融投资专业，经济学硕士；已通过 CFA 三级考试。期货从业资格证书号码：F0311395，投资咨询从业资格证书号码：Z0011793。多年来一直致力于量化交易研究工作（策略研发、组合构建、仓位管理、风险控制等）。擅长通过量化分析方法设计、优化交易模型并形成完整的交易系统，以实现特定风险要求时的最大稳定超额收益。

二、投资经理工作报告

2.1 投资策略

现金类：

本计划将在综合考虑投资组合配置需求和保持流动性需求的基础上，构建投资组合的现金管理组合，以保持资产的稳健性。

金融衍生品类：

根据现货头寸进行量化分析，确定用以对冲现货头寸贝塔风险的期货合约手数。

权益类：

依照基本面和量化指标筛选出具有高阿尔法收益的股票现货组合。

2.2 产品分析

2018年3月1日至3月22日，沪深300指数略有上涨，现货组合净值上涨，期货组合净值下跌，产品净值几乎维持不变；2018年3月23日，沪深300指数大幅跳水，股指期货相对于沪深300指数贴水超过2%，大幅贴水导致期货端收益远高于现货端亏损，产品净值上涨约1.5%；在此期间，为了应对大幅贴水事件，我司于3月26日对产品进行减仓操作；3月最后几天指数小幅震荡，股票组合净值下降，受前期股指期货大幅贴水影响期货组合净值亦下降，产品净值小幅下降。

2.3 研发进展

- 1、升贴水分析；
- 2、行业轮换及行业超配分析；

三、风险控制报告

在报告期内，管理人严格遵守《期货交易管理条例》、《期货资产管理业务试点办法》、《期货公司监督管理办法》、《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》等法律

法规、规章和自律规则等有关规定，以及本计划资产管理合同的约定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划。

报告期内，本计划管理人坚持规范运作、防范风险，保护投资者利益，严格执行管理人内部控制和 risk 管理制度，加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，严格履行本集合计划合同规定。

在报告期内，投资经理按照合同规定的投资范围进行投资，投资范围和投资比例符合合同规定，无越权交易行为发生。管理人和托管人按照各方约定的统一记账方法和会计处理原则，分别独立设置账套，每日核对资产净值，互相监督，以保证计划资产安全，保护投资者利益。

第五节资产配置情况

一、资产组合情况

项目名称	金额（元）	占总资产比例（%）
银行活期存款	0.22	0.00
清算备付金	1,458,321.43	24.14
存出保证金	350,145.19	5.79
股票投资	2,446,890.00	40.50
买入返售金融资产	1,787,017.87	29.57
应收利息	64.42	0.00
合计	6,042,439.13	100.00

二、资产负债情况

项目名称	金额（元）	占总负债比例（%）
管理费计提	7,454.03	84.75
运营服务费计提	745.40	8.47
托管费计提	596.39	6.78
合计	8,795.82	100.00

第六节计划份额变动

单位：份

期初份额总额	6,000,000.00
报告期间总参与份额（含红利再投份额）	0.00
报告期间总退出份额	0.00
报告期末份额总额	6,000,000.00

第七节重要事项提示

无。

第八节信息披露的查阅方式

网址：<http://www.fcfco.com.cn/>

联系电话：400-1818-811

第一创业期货有限责任公司

二〇一八年四月十三日

