

# 第一创业期货-睿博 11 号资产管理计划 2018 年第 6 月份报告

(2018 年 6 月 01 日—2018 年 6 月 30 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 6 月 01 日至 2018 年 6 月 30 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)

|          |              |
|----------|--------------|
| 本期净收益    | 340,736.46   |
| 期末计划资产净值 | 6,340,736.46 |

## 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6月1日至6月12日，沪深300指数震荡走平，股票现货组合净值稳步上升，期货头寸净值略有下降；2018年6月12日至6月30日，沪深300指数出现连续下跌行情，股票现货组合发生亏损，期货头寸产生盈利。产品在6月走势平稳，截止2018年6月30日，产品净值为1.0568。

#### 2.3 研发进展

- 1、研究上半年北上资金流入A股情况，为调整持仓结构做准备；
- 2、研究分析中报预报情况，以便分析了解现有持仓标的及备选标的的基本面是否发生重大变化。

### 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    | 990,804.60   | 15.60     |
| 存出保证金    | 470,405.68   | 7.40      |
| 股票投资     | 4,249,808.00 | 66.89     |
| 买入返售金融资产 | 642,006.42   | 10.11     |
| 应收利息     | 45.13        | 0.00      |
| 合计       | 6,353,070.05 | 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   | 7,728.31  | 62.66     |
| 运营服务费计提 | 772.82    | 6.27      |
| 托管费计提   | 618.26    | 5.01      |
| 应交税费    | 3,214.20  | 26.06     |
| 合计      | 12,333.59 | 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.fcfc.com.cn/>

联系电话：400-1818-811

第一创业期货有限责任公司

二〇一八年七月十一日

