

第一创业期货-睿博8号资产管理计划2019年第1月份报告

(2019年01月01日—2019年01月09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：2019年01月01日至2019年01月09日。

第二节重要提示

| | |
|----------|-------------------------------|
| 名称 | 第一创业期货-睿博8号资产管理计划 |
| 类型 | 封闭运作 |
| 成立日 | 2018年1月10日 |
| 报告期末份额总额 | 4,000,180.00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)

| | |
|----------|--------------|
| 本期末净收益 | -190,088.82 |
| 期末计划资产净值 | 3,810,091.18 |

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，根据现货指数大趋势对现货头寸进行择时套保。

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 量化对冲

2.2.1 股票市场及对冲策略运行状况

2019 年 1 月 2 日至 1 月 3 日，沪深 300 指数短暂回调，股票现货组合微调，期货头寸净值微跌；2019 年 1 月 4 日至 1 月 8 日，沪深 300 指数震荡走高，股票现货组合产生盈利，期货头寸出现亏损。产品在 1 月出现微亏。

2.2.2 研发方向

- 1、研究分析 A 股年报预告，以便了解公司经营情况及行业景气度并调整持仓结构；
- 2、研究行业量化选股方法；
- 3、完善多因子选股模型。考虑到传统因子拥挤造成的超额收益下降问题，正研发量价类因子辅助传统因子。

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 | 2,584,160.40 | 67.67 |
| 清算备付金 | 1,234,508.00 | 32.33 |
| 存出保证金 | 0.00 | 0.00 |
| 股票投资 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | 51.87 | 0.00 |
| 合计 | 3,818,720.27 | 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 | 104.85 | 1.21 |
| 基金服务费计提 | 52.44 | 0.61 |
| 托管费计提 | 8,471.80 | 98.18 |
| 应付税费 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 8,629.09 | 100.00 |

第六节 计划份额变动

单位：份

| | |
|--------------------|--------------|
| 期初份额总额 | 4,000,180.00 |
| 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

4,000,180.00

第七节重要事项提示

1、本计划已于2019年1月9日到期终止运营，进行产品清算。

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

二〇一九年二月十九日

