

第一创业期货-睿博3号资产管理计划 年度资产管理报告



资产管理人：第一创业期货有限责任公司

资产托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告期间：2016年6月30日至2016年12月31日

重要提示

本报告依据《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》（以下简称“《管理规则》”）及其他有关规定制作。

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。

托管人已复核本报告。本报告相关财务资料未经审计。

管理人、托管人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。本报告期间：2016年6月30日至2016年12月31日。



目 录

第一节 资产管理计划概况.....	4
第二节 资产管理计划财务指标.....	5
第三节 管理人报告.....	5
第四节 资产管理计划财务报告.....	7
第五节 计划份额变动.....	9
第六节 重要事项提示.....	9
第七节 信息披露的查阅方式.....	10

有
限
公
司

第一节资产管理计划概况

一、基本资料

名称	第一创业期货-睿博3号资产管理计划
类型	封闭运作
成立日	2016年06月30日
报告期末份额总额	17,000,000.00份
投资目标	在有效控制投资风险的基础上,为委托人追求资产的稳健增值。
投资策略	趋势策略和商品对冲策略为主
风险收益特征	本计划产品优先级计划份额风险等级为【中低风险】。 本计划产品进取级计划份额风险等级为【高风险】。
产品编码	SE0300
管理人	第一创业期货有限责任公司
托管人	国泰君安证券股份有限公司
注册登记机构	第一创业证券股份有限公司

二、管理人

名称: 第一创业期货有限责任公司

联系地址: 北京市西城区新街口北大街3号6层603、604室

法定代表人: 苏江

电话: 400-181-8811

传真: 010-88009301

网址: www.fcfco.com.cn

三、托管人

名称: 国泰君安证券股份有限公司

联系地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心32楼

法定代表人: 杨德红

电话: 95521

传真: 021-38676666

网址: <http://www.gtja.com>

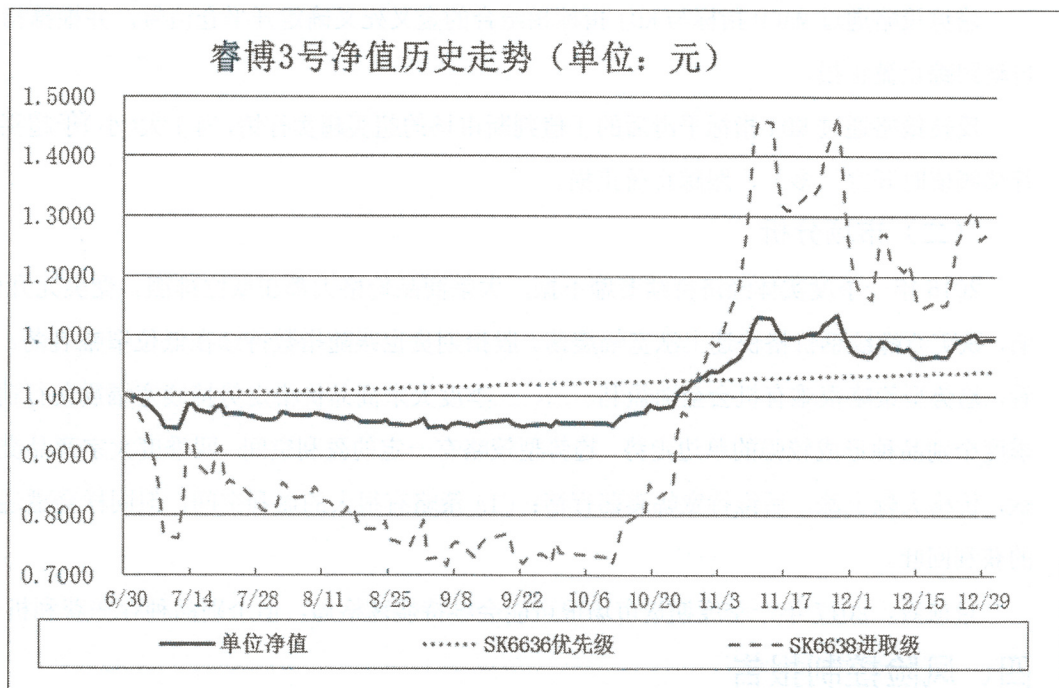
第二节资产管理计划财务指标

一、主要财务指标

(单位: 人民币元)

本计划期末净收益	1,599,365.94
期末计划资产净值	18,599,365.94
期末计划单位净值	1.0941
期末计划单位净值 A	1.0405
期末计划单位净值 B	1.2681

二、本计划净值历史走势图



第三节管理人报告

一、资产管理计划业绩表现

本计划于2016年06月30日成立,截至2016年12月31日,计划A份额单位净值1.0405,计划A份额自成立之日起累计净值增长率为4.05%。计划B份额单位净值1.2681,计划B份额自成立之日起累计净值增长率为26.81%。

二、 投资经理简介

韩伟先生,1982年出生;毕业于北京邮电大学计算机科学与技术专业;2007年进入期货行业,期货从业资格证书号码:F0248066,一直专注研究中国期货市场的量化对冲及套利交易模型和投资组合的优化方法。

二、 投资经理工作报告

(一) 工作报告

报告期内计划的投资策略为以突破、趋势和反转三类型策略相结合进行T+0双边投机交易。

突破策略以均线及波动率滤网辅助入场,反向突破信号离场,跟踪止盈止损。

趋势策略通过MACD指标与KDJ指标相结合的金叉死叉确定开平仓信号,并根据指标值自动跟踪止盈止损。

反转策略通过KDJ指标平滑后的J值判断市场的超买超卖行情,当J大(小)于超买(卖)行情阈值时开空(多),跟踪止盈止损。

(二) 市场分析

2016年一季度实体经济持续萎靡不振,大宗商品价格大都在低位徘徊。受美元升值影响,铁矿石螺纹钢价格快速上涨宽幅震荡。股指期货也跟随指数持续在低位窄幅震荡。综合看,趋势型策略很难有机会全面盈利。二、三季度大宗商品价格走势持续宽幅震荡行情,三季度个别品种形成较强的单边走势,趋势型策略有一定的盈利空间。四季度大宗商品交易活跃,价格大幅上涨,后维持宽幅震荡行情;CTA策略有很大的盈利空间,但同样会遭遇较大的获利回吐。

目前看,2017年一季度期货市场很可能会维持震荡格局,但个别品种存在获利机会。

四、 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》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。

第四节资产管理计划财务报告

一、资产管理计划资产负债表

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资 产：			负 债：		
银行存款	3.37	0.00	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	17,280,406.52	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	1,371,128.50	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算款	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00	应付管理人报酬	44,799.68	0.00
权证投资	0.00	0.00	应付外包费	2,239.98	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00	应付托管费	4,479.99	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	应付交易费用	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	应交税费	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	其他负债	652.80	0.00
其他资产	0.00	0.00	负债合计	52,172.45	0.00

产					
			所有者权益:		
			实收基金	17,000,000.00	0.00
			未分配利润	1,599,365.94	0.00
			所有者权益合计	18,599,365.94	0.00
资产合 计	18,651,538.39	0.00	负债和所有者权益总 计	18,651,538.39	0.00

二、资产管理计划损益表

序号	项目	本年累计数
1	一、收入	1,793,563.37
2	1、利息收入	1,533.37
3	其中：存款利息收入	1,533.37
4	债券利息收入	0.00
5	资产支持证券利息收入	0.00
6	买入返售证券收入	0.00
7	2、投资收益	1,073,180.45
8	其中：股票投资收益	0.00
9	债券投资收益	0.00
10	基金投资收益	0.00
11	权证投资收益	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00
13	衍生工具收益	1,073,180.45
14	股利收益	0.00
15	个股期权收益	0.00
16	3、公允价值变动收益	718,849.55
17	4、其他收入	0.00
18	二、费用	194,197.43
19	1、管理人报酬	85,916.97
20	2、外包费	4,295.87
21	3、托管费	8,591.68
22	4、销售服务费	0.00
23	5、交易费用	94,740.11
24	6、利息支出	0.00
25	其中：卖出回购金融资产支出	0.00
26	7、其他费用	652.80
27	三、利润总和	1,599,365.94

三、资产管理计划财产的会计核算

- 1、资产管理人为计划财产的会计责任方；
- 2、计划财产的会计年度为公历年的1月1日至12月31日；
- 3、计划财产的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本计划财产独立建帐、独立核算；
- 6、资产管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制计划财产会计报表。
- 7、资产托管人定期与资产管理人就计划财产的会计核算、报表编制等进行核对

第五节计划份额变动

单位：份

期初份额总额	17,000,000.00
报告期内总参与份额（含红利再投份额）	0.00
报告期内总退出份额	0.00
报告期末份额总额	17,000,000.00

第六节重要事项提示

一、本计划管理人及托管人相关事项

- 1、本计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。
- 2、本计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在本报告期内没有受到任何处罚。

二、本计划相关事项

- 1、本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大的改变。

第七节信息披露的查阅方式

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人第一创业期货有限责任公司。

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

二〇一七年三月三十日



第一创业期货-睿博 3 号资产管理计划 托管人报告

2016 年 6 月 30 日至 2016 年 12 月 31 日, 本计划托管人——国泰君安证券股份有限公司根据《第一创业期货-睿博 3 号资产管理计划资产管理合同》(以下简称《资产管理合同》), 在托管第一创业期货-睿博 3 号资产管理计划的过程中, 严格遵守《期货公司资产管理业务试点办法》及有关法律法规, 尽职尽责地履行了托管人应尽的义务, 不存在任何损害本计划份额持有人利益的行为。

报告期内, 计划管理人——第一创业期货有限责任公司在第一创业期货-睿博 3 号资产管理计划的投资运作、计划资产净值的计算、计划费用开支问题上, 托管人未发现损害计划份额持有人利益的行为。

报告期内, 由计划管理人所编制, 并经托管人复核的有关第一创业期货-睿博 3 号资产管理计划报告中的财务指标、净值表现、会计报表/告(若有)、投资组合报告、重大关联交易(若有)等信息真实、准确、完整。

国泰君安证券股份有限公司资产托管部

二〇一七年三月二十九日

