

第一创业期货-睿博5号资产管理计划

季度资产管理报告

(2016年10月1日—2016年12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。资产管理计划托管人中泰证券股份有限公司公司于2017年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

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：2016年10月01日至2016年12月31日。

第二节资产管理计划概况

一、基本资料

名称	第一创业期货-睿博5号资产管理计划
类型	封闭运作
成立日	2016年12月26日
报告期末份额总额	12,400,000.00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	本计划产品份额风险等级为【较高风险】。
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

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：中泰证券股份有限公司

联系地址：济南市经七路 86 号证券大厦 1006

法定代表人：李玮

电话：0531-68889568

传真：0531-68889445

网址：http:// www.zts.com.cn/

第三节资产管理计划净值表

一、 计划净值

(单位：人民币元)

本计划期末净收益	-63,281.26
期末计划资产净值	12,336,718.74
期末计划单位净值	0.9949

第四节管理人报告

一、 资产管理计划业绩表现

本计划于 2016 年 12 月 26 日成立，截至 2016 年 12 月 31 日，计划单位净值 0.9949，计划自成立之日起累计净值增长率为-0.51%。

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。

三、 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	0.00	0.00
期货账户余额	11,837,964.20	95.91
商品期货持仓保证金	503,852.70	4.08
应收利息	558.00	0.01
合计	12,342,374.90	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	5,402.91	95.52
外包服务费计提	84.42	1.49
托管费计提	168.83	2.99
其他负债	0.00	0.00
合计	5,656.16	100.00

第六节计划份额变动

单位：份

期初份额总额	12,400,000.00
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	12,400,000.00

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

二〇一七年一月二十日