

# 第一创业期货-睿博 11 号资产管理计划 2018 年第 9 月份报告

(2018 年 9 月 01 日—2018 年 9 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 9 月 01 日至 2018 年 9 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	62,102.55
期末计划资产净值	6,062,102.55

## 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 量化对冲

##### 2.2.1 股票市场及对冲策略运行状况

2018 年 9 月 3 日至 9 月 12 日，沪深 300 指数震荡下跌，股票现货组合净值发生亏损，期货头寸净值出现盈利；2018 年 9 月 13 日至 9 月 28 日，沪深 300 指数出现反弹行情，股票现货组合净值持续上升，期货头寸小幅亏损。产品在 9 月出现微亏，截止 2018 年 9 月 28 日，产品净值为 1.0104。

##### 2.2.2 研发方向

1、研究分析三季报情况，对股票池中标的经营情况进行了解分析，为调整持仓结构做准备；

2、完善多因子选股模型。利用多因子量化模型预测股票超额回报，目前经过精选的因子主要有如下几类：估值、动量、成长等。

### 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	740,170.78	12.19
存出保证金	619,830.14	10.20
股票投资	4,615,861.00	76.01
买入返售金融资产	97,000.97	1.60
应收利息	2.10	0.00
合计	6,072,865.21	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	7,790.91	72.39
运营服务费计提	779.11	7.24
托管费计提	623.27	5.79
应交税费	1,569.37	14.58
合计	10,762.66	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

二〇一八年十月十八日

