

新湖期货锡渊1号资产管理计划

募集说明

XINHU
FUTURES

上海锡渊投资管理有限公司 简介

❖ 注册资本：1000万人民币

❖ 投资理念：

公司秉承“优化配置，稳健回报”的投资理念，以“投资者资产可持续增长”为己任，利用管理团队在资本投资领域数十年的积累，全力实现管理资产的增值目标，致力于成为一家具有深远影响力的专业资产管理公司。

财富共享才最有价值

上海锡渊投资管理有限公司 简介

❖ 投资总监 韩志栋

上海交通大学数学系本科学历，金融行业从业经历8年，先后任职于国内大型银行和知名基金公司。

❖ 投资经理 金毅敏

上海师范大学管理系本科学历，证券投资经验9年，先后任职于知名互联网金融公司。

财富共享才最有价值

风险控制和组织架构

- ❖ 团队有独立的风控人员对盘面进行量化风控，每周的投资会议会对风险头寸进行宏观评估。投资决策委员会是公司最高决策机构，下设投资经理以及交易员风控员。

根据经济周期和行业轮动规律，及时调整和降低风险头寸规模；如果出现净值破位，首先降低头寸，然后利用小头寸慢慢恢复净值。

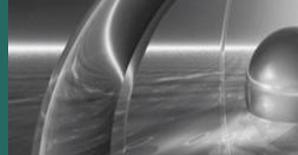
财富共享才最有价值

投资决策

研究员或研究小组根据“三钻头”模型确定未来投资周期内的研究专题，按照“行业与公司研究模型”完成投资标的的研究与实地调研，并提出投资建议；上述研究成果经投资决策委员会的严格审核后，进入公司两级股票池；基金经理可根据集中组合的投资原则，合理配置相应的投资标的，并接受风险控制委员会的监督。公司的风险控制体系贯穿于整个研究、决策和交易过程。核心的风控措施通过交易软件确保实施。

财富共享才最有价值

要素表



产品名称	新湖期货锡渊1号资产管理计划
产品类型	管理型产品
存续期限	不设固定期限
运作方式	定期开放，产品成立后封闭12个月，每12个月最后5个交易日开放
发行规模	初期成立规模1000万元以上
管理人	新湖期货
投资顾问	上海锡渊投资管理有限公司
托管人	国信证券股份有限公司
投资范围	股票，债券，基金买卖，债券回购，LOF申赎，金融期货，商品期货，公募基金，融资融券，ETF套利，期权。
投资策略	股票多空策略，股指期货跨期套利、期现套利等 资产配置：0-100%股票、基金、债券等现货；0-30%股指期货、期权等衍生品
投资比例限制	创业板单票占比不超过20%，总体持仓占比不超过30%；主板/中小板单票占比不超过50%
风险控制	不设预警线，止损线0.80
费率结构	认购费：1%，管理人有权对个别投资人的认购费进行减免
	管理费：0.1%
	托管费：0.15%
	行政外包服务费：0.15%
	投资顾问费：2.0%
	投资顾问的业绩报酬：20%