

# 徽金宝

2017年12月

徽商期货投资咨询部监制

## 目 录

一、产品方案.....	1
1 产品设计理念 .....	1
2 产品特点 .....	1
3 目标客户 .....	1
4 产品概况 .....	1
二、产品回测绩效 .....	2
1 回测概况 .....	2
2 权益曲线图 .....	3
3 损益曲线图 .....	5
三、模拟运行绩效 .....	7
四、风险提示函 .....	8
五、研发人员 .....	9

## 一、产品方案

### 1 产品设计理念

- 1、市场的不确定；
- 2、明确的进出场规则并且一致执行；
- 3、顺势；
- 4、在风险可控前提下扩大盈利；
- 5、小止损，大收益；

### 2 产品特点

- 1、风险可控；
- 2、止损小，盈利大；
- 3、普适性，适合各类商品期货、股指期货、国债以及股票；

### 3 目标客户

- (1) 偏进取型的个人投资者；
- (2) 多策略组合配置的金融机构客户、产业机构客户和个人高端客户。

### 4 产品概况

产品名称	徽金宝
产品类型	限亏浮动收益型
起步资金	个人操作视品种而定，资管委托 100 万起

投资理念	顺势而为，捕捉趋势，风险可控前提下扩大盈利
投资范围	各类商品期货、股指期货、国债期货以及股票
风险收益特征	风险较低，收益稳定
限亏比例	20%
预警比例	15%

## 二、产品回测绩效

### 1 回测概况

回测时间：2009.1.1-2017.1.1

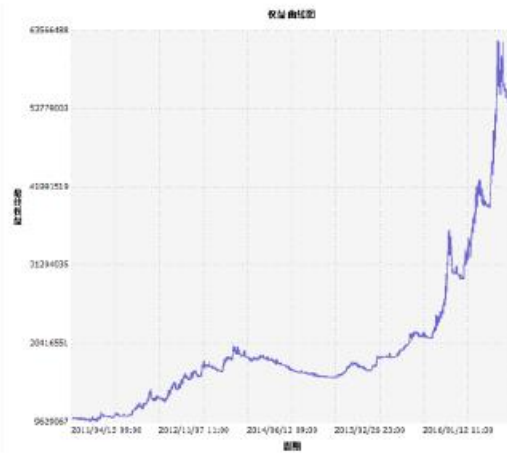
品种上市日：2017.1.1

手续费：交易所手续费

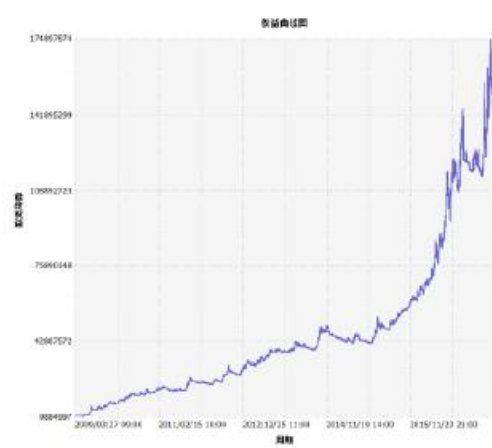
品种	收益率	最大回撤比率	资金最大使用比例
焦炭 <b>j</b>	<b>93.50%</b>	<b>17.30%</b>	<b>20%</b>
螺纹 <b>rb</b>	<b>181.00%</b>	<b>10.99%</b>	<b>20%</b>
热卷 <b>hc</b>	<b>71.42%</b>	<b>12.92%</b>	<b>20%</b>
沥青 <b>bu</b>	<b>42.35%</b>	<b>20.69%</b>	<b>20%</b>
郑棉 <b>cf</b>	<b>58.45%</b>	<b>16.89%</b>	<b>20%</b>
动力煤 <b>zc</b>	<b>58.65%</b>	<b>12.99%</b>	<b>20%</b>
锰硅 <b>sm</b>	<b>108.78%</b>	<b>21.78%</b>	<b>20%</b>

2 权益曲线图

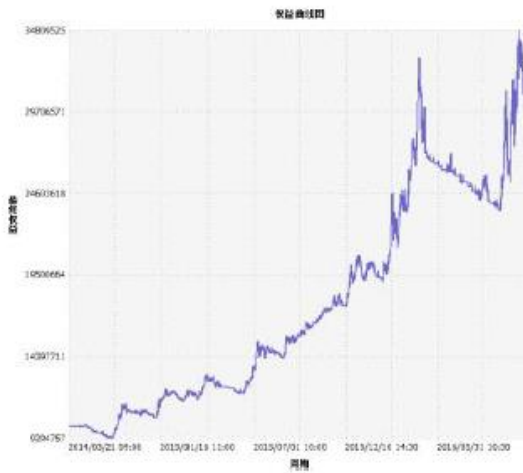
焦炭 j:



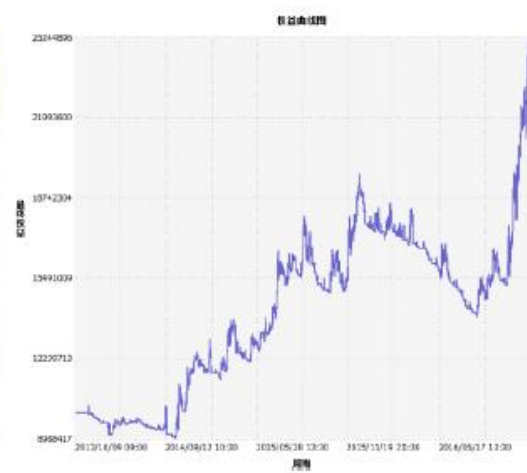
螺纹 rb:



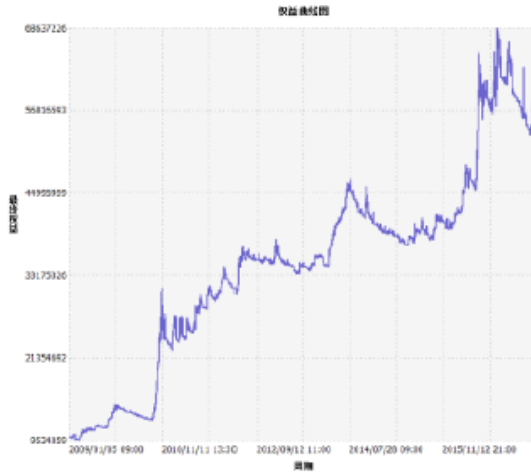
热卷 hc:



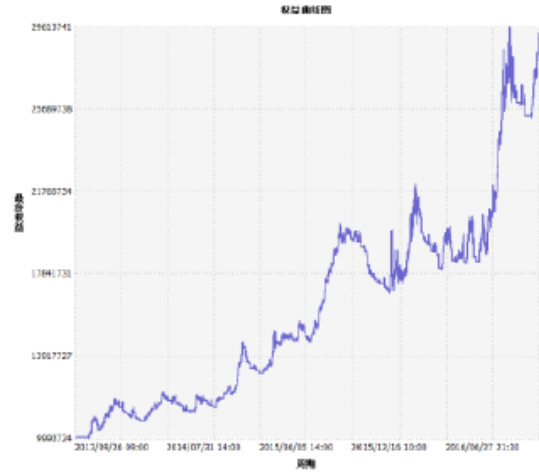
沥青 bu:



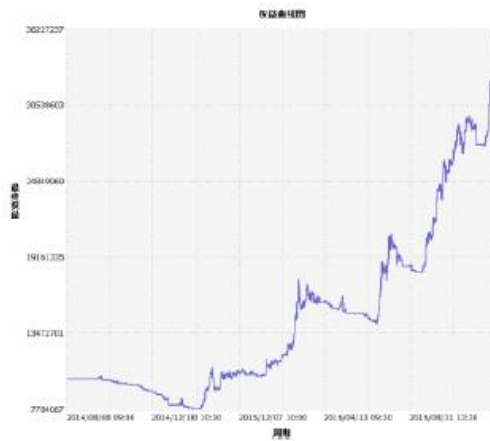
**棉花 CF:**



**动力煤 ZC:**

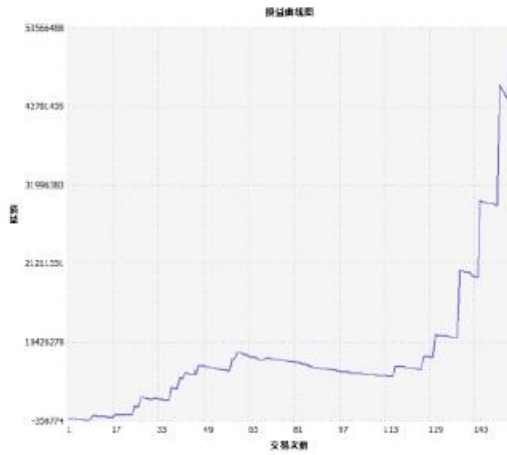


**锰硅 SM:**

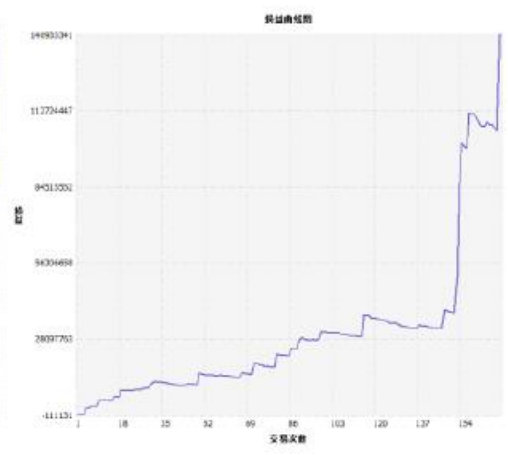


3 损益曲线图

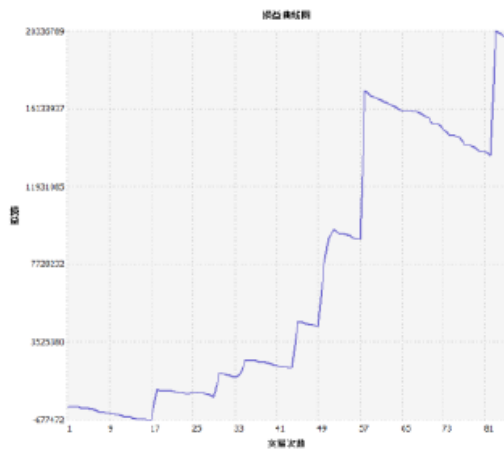
焦炭 j:



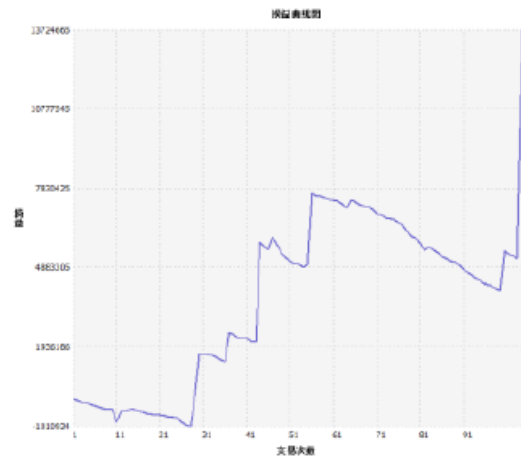
螺纹 rb:



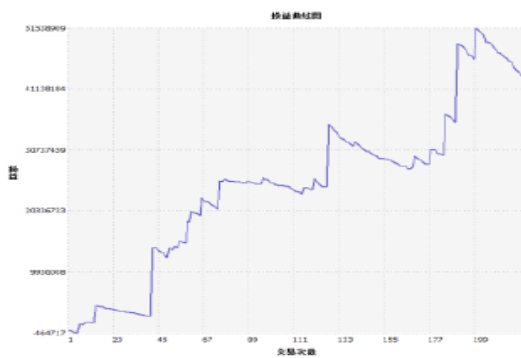
热卷 hc:



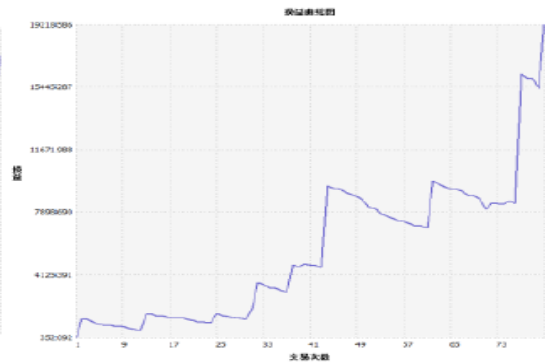
沥青 bu:



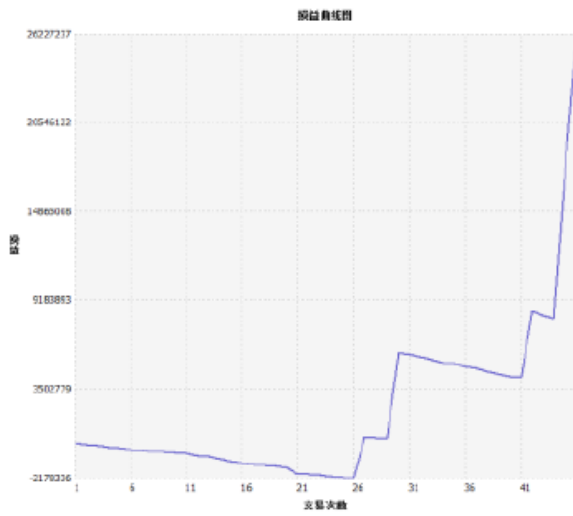
棉花 CF:



动力煤 ZC:

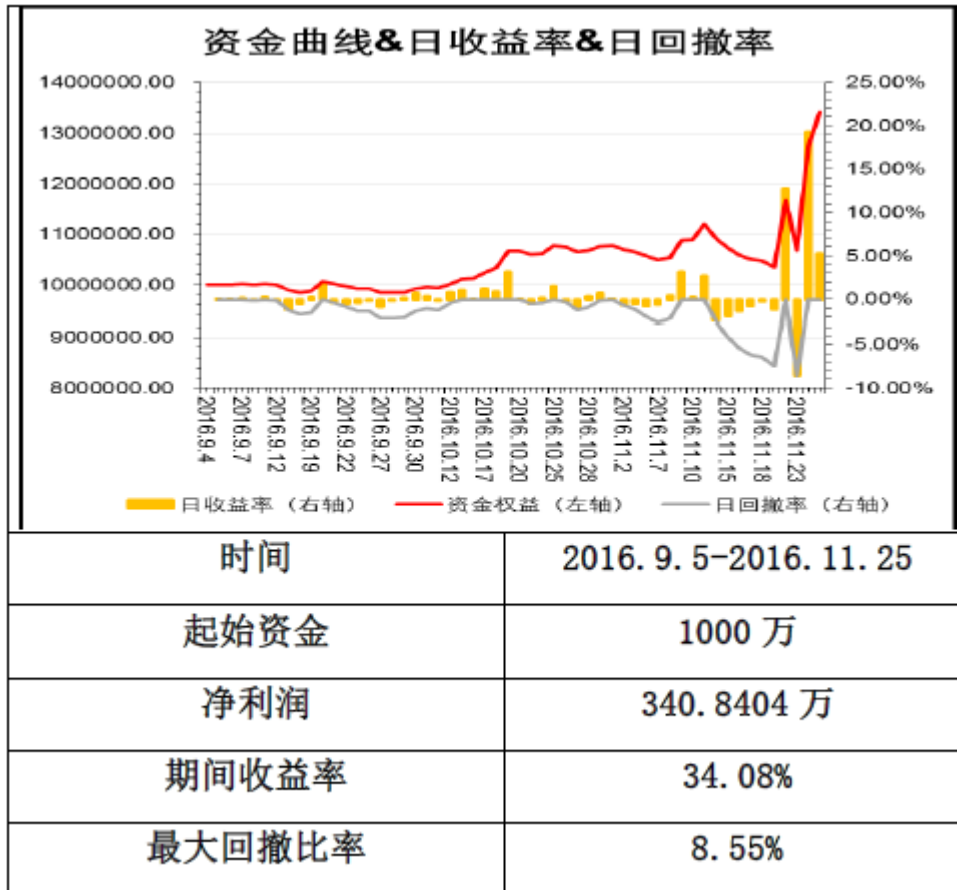


锰硅 SM:





### 三、模拟运行绩效



#### 四、风险提示函

为了使投资者充分了解投资咨询业务风险，徽商期货有限责任公司（简称“投顾方”）在此向投资者充分揭示参与投资咨询业务可能存在的风险，详细说明相关风险的含义、特征、可能引起的后果。

一、投资者在参与投资咨询业务前，应该了解有关投资咨询业务的法律法规、基础知识、业务特点、风险收益特征等内容，了解投顾方是否具有开展投资咨询业务的资格，并已经认真听取投顾方对相关业务规则和投资咨询合同内容的讲解。

二、投资者在参与投资咨询业务前，应综合考虑自身的资产与收入状况、投资经验、风险偏好，确信自身有承担参与投资咨询业务所面临投资风险和损失的能力，审慎选择与自身风险承受能力相匹配的投资咨询投资策略。

三、投资者应了解参与投资咨询业务通常具有的市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险及其他风险，包括但不限于政策风险、经济周期风险、利率风险、技术风险、操作风险、不可抗力因素导致的风险等。

四、投资者应特别关注投资期货类品种具有的特定风险，包括但不限于因保证金交易方式可能导致投资损失大于委托资产价值的风险，因市场流动性不足、交易所暂停某合约的交易、修改交易规则或采取紧急措施等原因，导致未平仓合约可能无法平仓或现有持仓无法继续持有的风险。

五、本产品虽然约定了一定的止损比例，但由于持仓品种价格可能持续向不利方向变动、持仓品种因市场剧烈波动导致不能平仓等原因，资产亏损存在超出该止损比例的风险。

六、投资者参与投资咨询业务的资产损失由投资者自行承担，投顾方不以任何方式对投资者做出取得最低收益或分担损失的承诺或担保。

七、投资者无论参与投资咨询业务是否获利，都需要按约支付交易费用和其他费用，这些费用会对投资者的账户权益产生影响。

八、投资者委托期间，投顾方在一定条件下存在变更投资经理人选的可能，会对投资咨询投资策略的执行产生影响。

九、投顾方既往的投资咨询业绩并不预示其未来表现。投顾方介绍的预期收益仅供投资者参考，不构成对委托资产可能收益的承诺或暗示。

十、本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与投顾方投资咨询业务所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。

本材料仅作为宣传材料，不作为任何法律文件，也不构成任何法律承诺。投资有风险，请认真阅读本产品《徽商期货投资咨询合同》和《产品说明书》等文件。

## 五、研发人员

蒋贤辉 投资经理 TEL:0551-62865989 Email: 396190119@qq.com

投资咨询从业证号：Z0011822