

# 况客科技 FOF 管理系统介绍

## 公司介绍

---

况客科技（北京）有限公司成立于 2014 年，公司为金融机构的投资研究和资产管理提供系统化、专业化的解决方案，主要有两个产品：投资研究系统（解决方案）和 FOF 投资管理系统（解决方案），主要满足大型金融机构投资管理，特别是委托投资管理、投资研究管理中数据收集、整理、汇总、分析、可视化呈现、团队内外部分享等业务需要。目前公司共有员工近四十人，总部在北京，包括核心技术团队、研究团队、咨询团队、况客学院、数据团队、客服团队等，在上海、深圳、北京均有销售办公室，另外在厦门拥有一支投资专业的团队负责开发和维护况客自己的股票因子等。

## 人员资质

---

公司创始人、CEO 林伟平先生，曾任全国社会保障基金理事会境外投资部副处长，社保基金海外 FOF 投资业务负责人，所管理资产逾 200 亿美元，拥有 12 年金融投资经验。

公司 Co-CEO 欧阳明清博士，有近二十年在美国著名金融机构（嘉信理财、富达投资等）从事定量研究与投资组合管理的经验，在传统和另类投资领域有很强的研发及实施能力，尤其擅长全球资产配置及 FOF 组合的开发和管理，参与管理资产 300 亿美元。

作为产品设计人，他们熟悉境内外投资机构的投资流程、投研体系、风控体系、金融产品以及投资管理系统，并对资产配置、投资策略评估、管理人选择等方面具有深入的研究和丰富的实际操作经验。

开发团队核心人员曾供职于国家电网、搜狐、有货网等科技公司，从事构建数据平台、程序开发、网络安全、社交等方面的工作，擅长大数据与垂直搜索、行情应用、金融数据应用、数据可视化等。

## 功能简介

---

- **公募基金数据库服务模块：**公募基金库中包含 7706 支公募基金数据，每天系统会对数据进行自动更新确保数据状态为最新状态。可以查看到基金的分析总览、净值报告分析、风格报告分析、持仓行业比较。用户可以查看公募基金信息，了解现在该基金业绩分析情况，也可以添加净值指标、

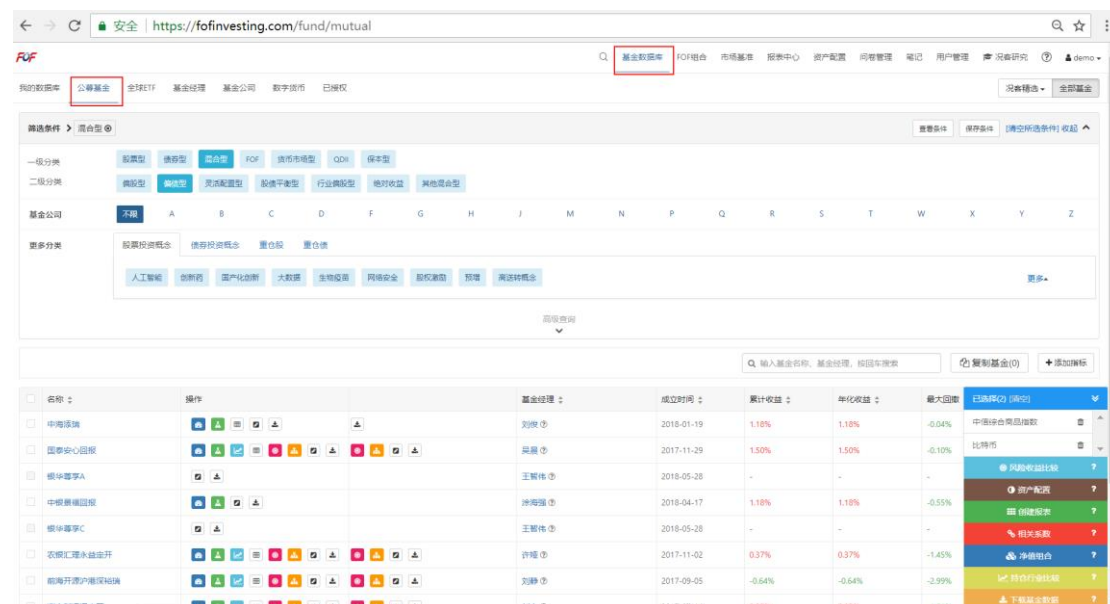
风险指标、收益指标等等。还可以使用公募基金数据进行创建组合或创建报表，也可以与我的数据库中的基金组合进行对比。

- **基金经理数据库服务模块：**将国内所有的基金经理及所管理的产品整理入库，查看基金经理所管理的产品，创建回测组合，迅速了解市场基金经理职业生涯的业绩分析。
- **基金净值分析功能服务模块：**基于基金净值数据统一标准计算各种的风险收益指标、进行风格分析，并以支持时间维度灵活度实时计算的可视化报告形式展现分析结果，生成可以打印、授权分享和转为 PDF 格式的净值分析报告；
- **FOF 组合分析服务模块：**支持选择多个基金创建自定义组合，根据所选取基金的历史净值统一标准计算各种的风险收益指标、进行风格分析，并以支持时间维度灵活度实时计算的可视化报告形式展现分析结果，生成可以打印和转为 PDF 格式的组合净值分析报告；
- **基金对比分析服务模块：**任选多只基金进行比较分析，提供详细的基金对比分析报告；
- **资产配置服务模块：**选择多个基金，自动计算资产配置相关计算，支持 MV 有效边界、Risk-Parity、Black-Litterman 等主流资产配置模型。可手动调整权重、预期收益、波动性、相关系数等。还支持自定义创建分析框架，可选择指标创建和状态创建，或者选择况客提供的经典分析框架，美林时钟个和历史数据；
- **风格分析功能服务模块：**基于基金的净值表现，运用不同的风格指数做多元回归拟合，确定基金的风格；
- **持仓截面分析服务模块：**估值表解析服务，并基于估值表信息生成持仓截面分析和风格分析报告，并以支持时间维度灵活度实时计算的可视化报告形式展现分析结果，生成可以打印和 PDF 格式的分析报告；
- **持仓时间序列分析服务模块：**支持对多份估值表进行时间序列分析和风格分析报告，生成打印版和 PDF 版的持仓时间序列分析报告；
- **量化选股分析服务模块：**基于估值表中的股票，支持对行业、个股、PE、PB 的偏离情况进行分析；
- **多期业绩归因分析服务模块：**根据用户上传的估值表信息进行绩效分解归因分析，多个时间段的持仓情况进行分析，生成归因分析报告；
- **收益率分解服务模块：**将组合收益拆分成各大类资产收益，可以查看收益情况图和收益详细信息；
- **自定义基准服务模块：**提供常用指数、支持用户根据现有指数进行自定义组合、自定义指数，并可以在净值分析中选择指数数据库中的指数作为分析基准；

- **自动化报告业绩分析服务模块：**基于持仓的投后分析报告、净值的风险收益分析报告、归因分析报告等一键生成；
- **自定义数据监控台服务模块：**支持选取不同产品同一时间区间的各个维度的指标，满足临时数据报送的需求（仓位数据、净值数据、历史数据），自动生成报表，支持自定义图表等；
- **自定义基金评分体系服务模块：**为基金的单一指标评级和多指标综合评级提供支持。可设置基本评分、综合评分两种评分类型。选择评分指标、添加评分分组选择模型后即可创建一套评分标准。评分模型分为五种：正态分布模型、均值方差模型、条件分布模型、排名模型和占比分位模型。对于不同的评分模型还可以设置相应的数值操作：是否去除异常值、是否逆序、是否自动计算、分数区间设置、条件设置等。
- **用户管理功能服务模块：**提供查看、新增、编辑、删除用户，邀请用户，用户分组以及导出用户列表等服务；
- **问卷及服务分析模块：**提供问卷的查看、新增、编辑、删除、发放以及回收问卷结果的统计分析等服务；

## 功能概览（图）

**公募基金数据库服务模块：**支持漏斗式筛选，快速筛选出符合条件的公募基金。



The screenshot shows the '公募基金数据库' (Public Fund Database) interface. It features a funnel-style filter on the left for selecting funds based on categories like '基金类型' (Fund Type), '基金经理' (Fund Manager), and '基金公司' (Fund Company). The main area displays a table of fund data with columns for '名称' (Name), '操作' (Action), '基金经理' (Fund Manager), '成立时间' (Establishment Time), '累计收益' (Cumulative Return), '年化收益' (Annualized Return), '最大回撤' (Maximum Drawdown), and '已选基金' (Selected Funds). The table lists several funds, including '中海蓝筹', '国寿安心回报', '银华尊享A', '银华尊享B', '银华尊享C', '农银汇理永益宝', and '前海开源沪港深成长精选'.

名称	操作	基金经理	成立时间	累计收益	年化收益	最大回撤	已选基金
中海蓝筹		刘峻	2015-01-19	1.18%	1.18%	-0.04%	中海蓝筹(混合)
国寿安心回报		吴晨	2017-11-29	1.50%	1.50%	-0.10%	国寿安心回报(混合)
银华尊享A		王健伟	2018-05-28	-	-	-	银华尊享A(混合)
银华尊享B		王健伟	2018-04-17	1.18%	1.18%	-0.55%	银华尊享B(混合)
银华尊享C		王健伟	2018-05-28	-	-	-	银华尊享C(混合)
农银汇理永益宝		许晓	2017-11-02	0.37%	0.37%	-1.45%	农银汇理永益宝(混合)
前海开源沪港深成长精选		刘峻	2017-09-05	-0.64%	-0.64%	-2.99%	前海开源沪港深成长精选(混合)
银华尊享D		刘峻	2017-07-14	3.03%	3.03%	-1.84%	银华尊享D(混合)

**基金经理数据库服务模块：**快速了解市场基金经理整体情况和历史业绩。

## 胡涛

### ● 基本信息

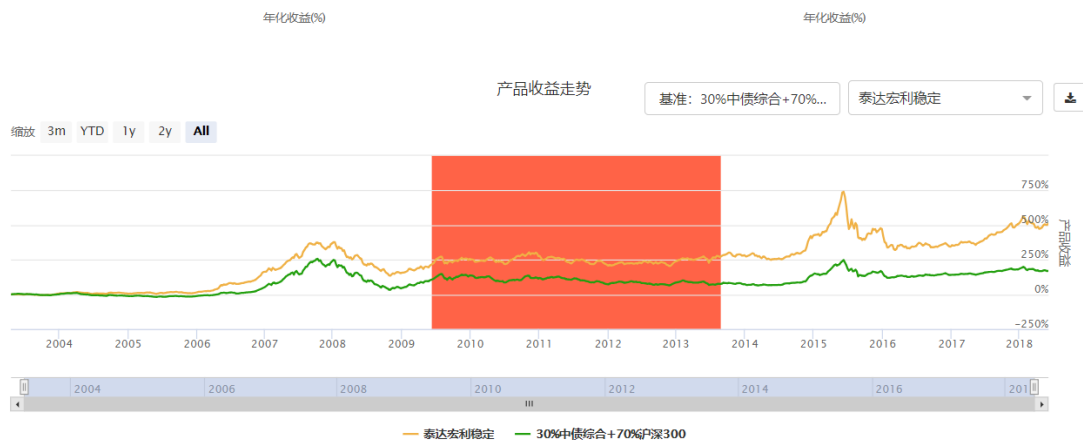
#### 简介

美国印第安纳大学凯利商学院MBA, CFA, 具有基金从业资格。1999年7月至2000年7月就职于北京证券有限责任公司任投资银行部经理, 2002年6月至2003年6月就职于中国国际金融有限公司任股票研究经理, 2003年7月至2004年4月就职于长盛基金管理有限公司任研究员, 2004年9月至2007年4月就职于友邦华泰基金管理有限公司任基金经理助理。胡涛先生于2007年4月加盟泰达荷银基金管理有限公司, 先后担任专户投资部副总经理、研究部研究主管等职务。曾任泰达宏利基金管理有限公司专户投资部副总经理、研究部研究主管、基金经理等职务。2009年6月13日至2013年8月30日担任泰达宏利稳定基金经理。2009年12月23日至2014年3月25日担任泰达宏利效率优选基金经理。2014年8月20日起担任嘉实优质企业股票型证券投资基金基金经理。

公司	年限	毕业院校	学历	平均波动性	
				混合型	混合型
嘉实基金	9.0 年	-	硕士	22.68%	9.74%

### ● 任职产品信息

产品一览							创建回测组合 ▾
产品名称	产品代码	任职期	基金类型 ▾	累计收益 ▴	年化收益 ▴	最大回撤 ▴	波动性 ▴
泰达宏利稳定	162203.OF	2009-06-12 至 2013-08-29	混合型	15.63%	3.51%	-26.83%	18.54%
嘉实优质企业	070099.OF	2014-08-19 至 2018-06-07	混合型	102.58%	20.44%	-49.66%	31.25%
泰达效率	162207.SZ	2009-12-22 至 2014-03-24	混合型	24.37%	5.26%	-35.67%	18.24%



**基金净值分析功能服务模块：**统一标准计算各种风险收益指标、支持时间维度灵活度的实时计算。

# 基金B 净值分析报告

● 产品概况

上证综指



● 业绩概览

	项目	基金B 净值	上证综指 净值
收益	期间收益	-11.57%	54.38%
	年化收益	-4.55%	17.88%
	年化超额收益	-22.43%	0.00%
	12 个月滚动收益均值	-9.90%	18.92%
	12 个月滚动收益最低	-29.24%	-36.76%
	12 个月滚动收益最高	16.81%	126.15%
风险	波动性	20.28%	28.75%
	下行风险	13.35%	21.75%
	最大回撤	-43.66%	-48.60%
风险调整	Sharpe	-0.224	0.622
	Sortino	-0.341	0.822
相关性	相关系数	15.37%	100.00%
	Beta	0.106	1.000

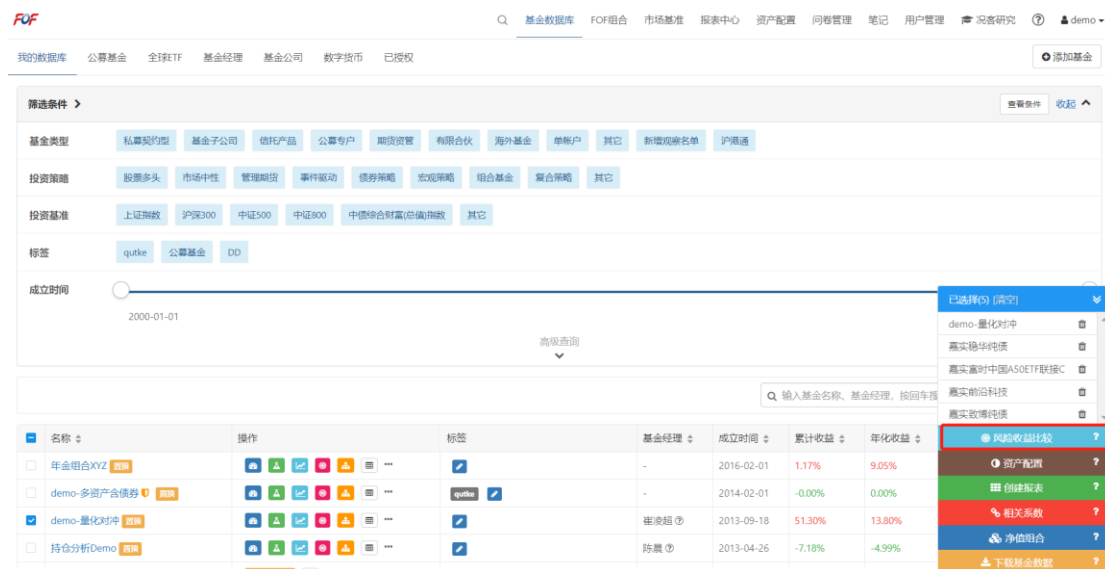
● 业绩分析



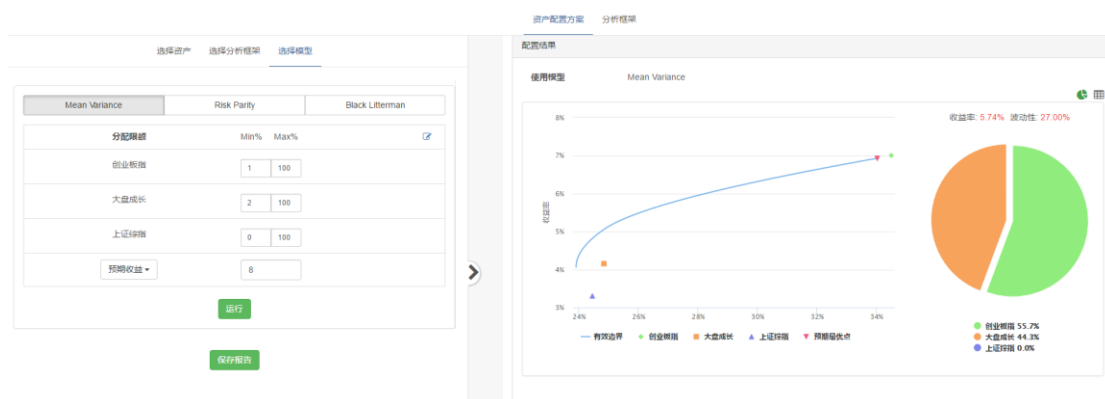
**FOF 组合分析服务模块：**将任选多只基金形成模拟组合，计算风险收益特征，自动生成分析报告。



**基金对比分析服务模块：**勾选多只基金进行统一的风险收益指标计算，支持跨数据进行比较。



**资产配置服务模块：**选择多个基金，自动计算资产配置有效边界，可手动调整权重、预期收益、波动性、相关系数等



**风格分析功能服务模块：**基于净值数据，对基金进行风格分析及跟踪。





持仓截面分析服务模块：支持主流估值表上传、解析，对单份估值表进行截面分析，对多份估值表进行时间序列分析；

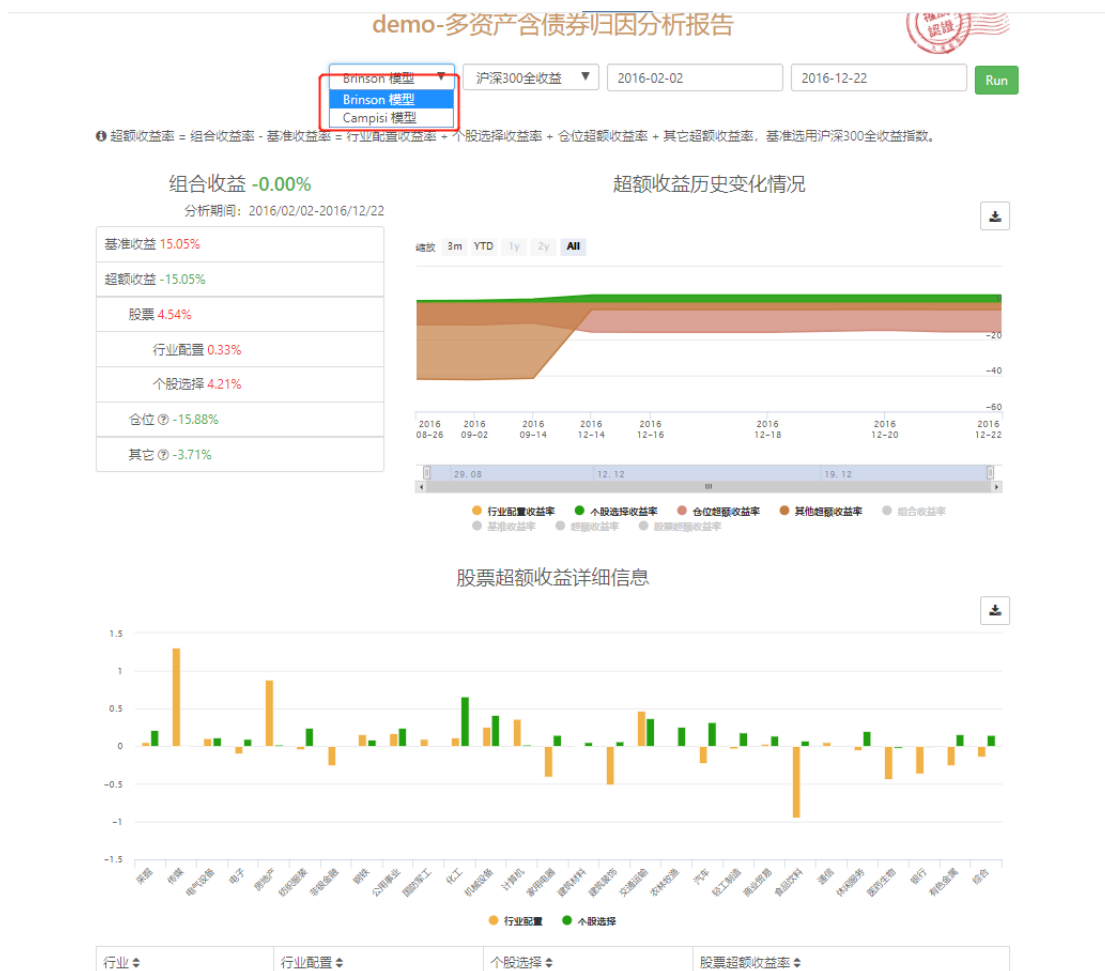




**量化选股分析服务模块：**基于估值表中的股票，支持对行业、个股、PE、PB 的偏离情况进行分析



**多期业绩归因分析服务模块：**根据估值表数据进行绩效分解，生产归因分析报告



**收益率分解服务模块：**将大类资产细分，可以查看每类资产当中每一细项的收益情况。

## demo-多资产含债券收益率分解分析报告



2016-02-02

2016-12-22

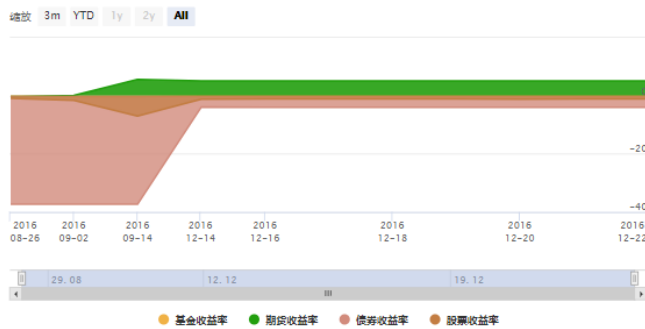
Run

组合收益 **0.00%**

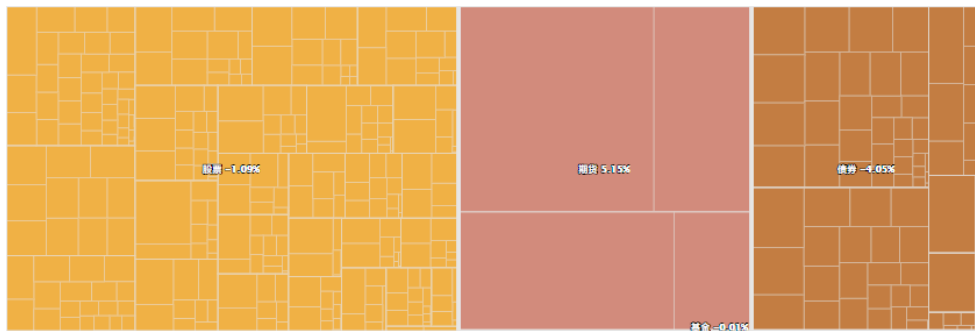
分析期间: 2016/02/02-2016/12/22

组合收益 <b>0.00%</b>
股票收益 -1.09%
债券收益 -4.05%
期货收益 <b>5.15%</b>
基金收益 -0.01%

超额收益历史变化情况



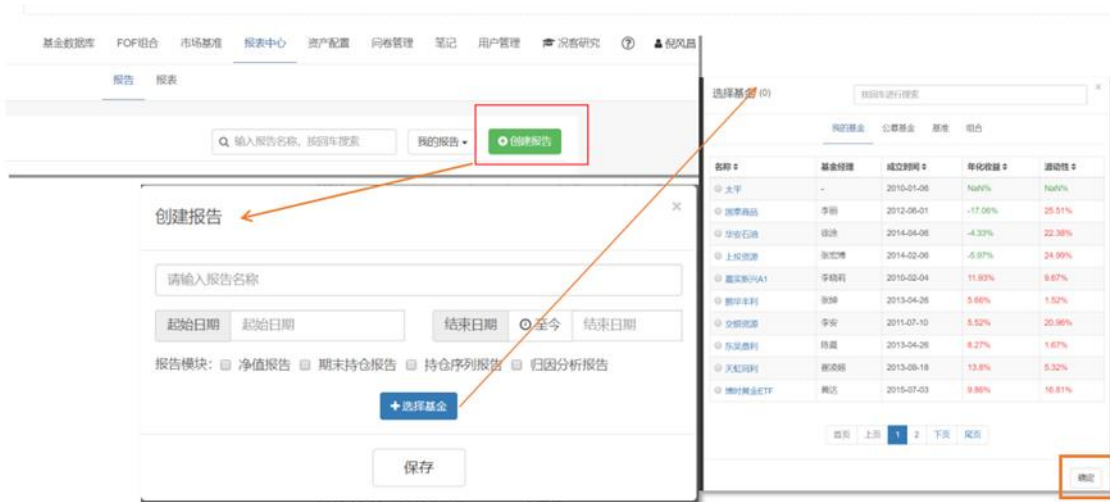
收益详细信息



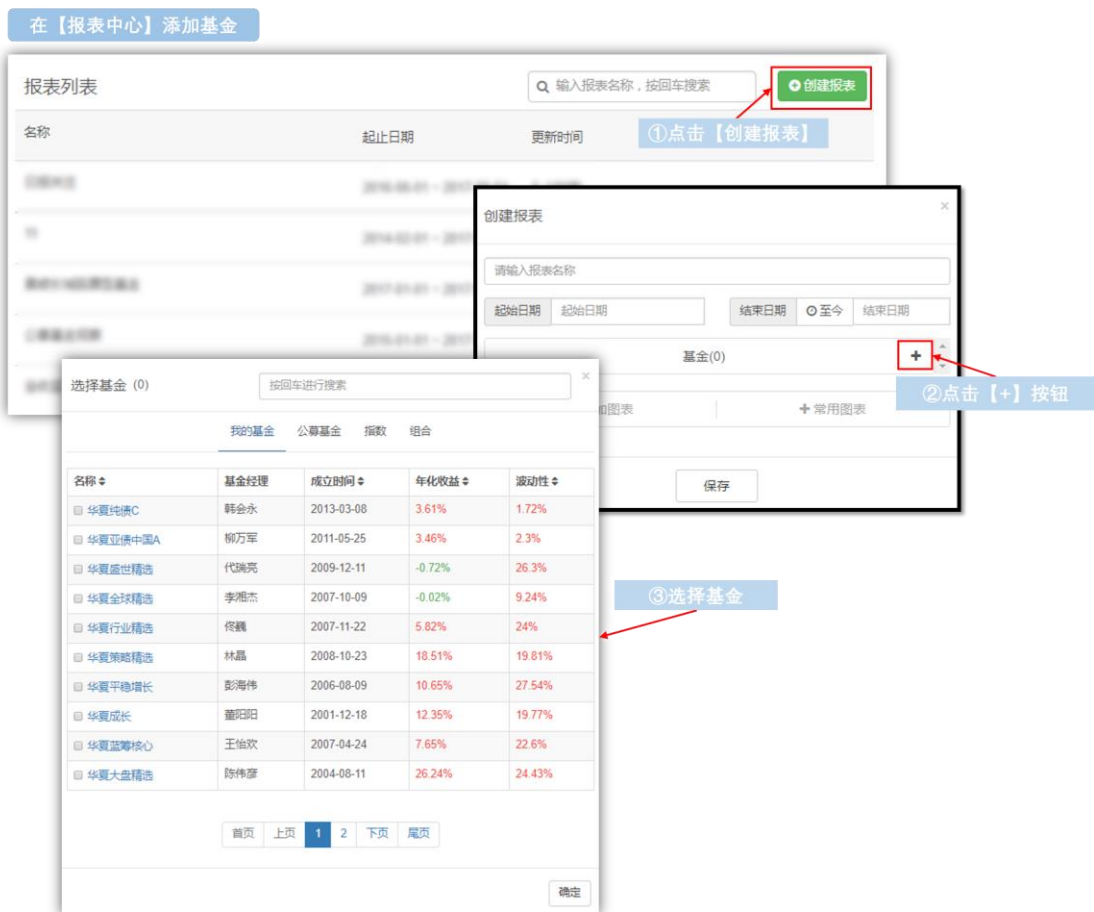
**自定义基准服务模块：**基准库，支持国内基准、自定义手动添加基准、按照自己的权重自定义创建组合基准。

名称	操作	基金经理	成立时间	累计收益	年化收益	持仓天数	波动性	最近基金经理任职年限	下行风险
<input type="checkbox"/> 中证综合商品指数	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2009-04-03	8.33%	0.88%	0	14.01%	-	10.20%
<input type="checkbox"/> 恒生指数	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2002-01-02	221.27%	7.56%	0	22.22%	-	15.55%
<input type="checkbox"/> 中证综合财富(总值)指数	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2002-01-04	78.21%	3.67%	0	1.95%	-	1.29%
<input type="checkbox"/> 黄金价格	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2008-01-09	22.20%	2.03%	0	21.02%	-	14.57%
<input type="checkbox"/> 中证信用债总财富(总值)指数	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2007-01-04	62.28%	4.49%	0	1.28%	-	0.76%
<input type="checkbox"/> 上证50	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2004-01-02	193.60%	7.99%	0	27.57%	-	19.29%
<input type="checkbox"/> 中证价值	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2002-12-31	531.53%	13.03%	0	30.15%	-	22.21%
<input type="checkbox"/> 中证高信用等级债券财富(总值)指数	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2006-01-04	65.13%	4.26%	0	1.34%	-	0.81%
<input type="checkbox"/> 上证综指	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2002-01-04	111.86%	4.80%	0	25.27%	-	18.12%
<input type="checkbox"/> 小盘价值	<a href="#">A</a> <a href="#">+</a> <a href="#">-</a>	-	2002-12-31	588.77%	13.71%	0	31.11%	-	23.14%

**自动化报告业绩分析服务模块：**月报模板，一键生成自动化报告



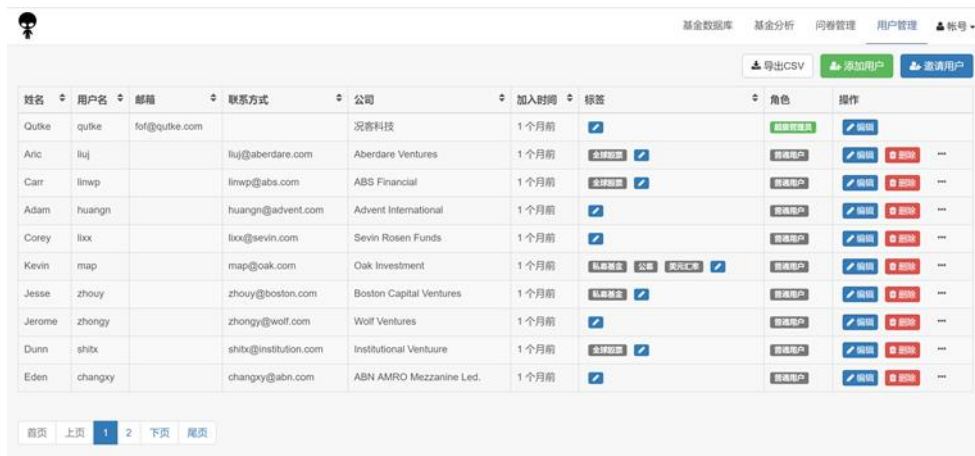
**自定义数据监控台服务模块：**满足临时数据报送的需求（仓位数据、净值数据、历史数据）



**自定义基金评分体系服务模块：**为基金的单一指标评级和多指标综合评级提供支持



**用户管理服务模块：**管理人联系信息数据库（支持分组，自动邮件提醒等功能）



**问卷及服务分析模块：**委外信息标准化收集的工具，支持投前 RFP 收集、投后仓位报送、管理人观点调查等功能

公司情况
人员情况
投资理念
投资流程
投资业绩
客户服务
附件上传

### 基金管理人RFP ( Refer for Proposal ) 问卷---标准版

按照国际通行的资产管理人选聘标准，参照国内外多家养老金、主权财富基金、央行、家族财富管理办公室、保险公司、证券公司、FoF基金等机构投资者进行外部管理人选聘所采用的RFP问卷，并根据国内开展管理人选聘业务的机构投资者的反馈意见，经综合整合而成该标准RFP问卷，旨在从公司基本面（Company Fundamentals）、人员情况（Person）、投资理念（Philosophy）、投资流程（Process）、投资业绩（Performance）、客户服务（Customer Service）六个维度（2C+4P）来全面衡量管理人的公司治理水平和资产管理能力。

请基金管理人根据实际情况及时准确更新相关信息。所有信息将作为机构投资者进行管理人筛选、选聘管理人的重要参照。除了作为资金方筛选和选聘基金的参考用途外，所有信息将被严格保密，不会用于其他任何用途。

填写说明：

如果需要填入为数字，一律按真实数字填写，如30%填写为0.3，-0.5%填写为-0.005。

1、公司股权结构

请列出公司主要股东的情况

股东名称	股权占比
	请输入数字

FOF

基金数据库

基金分析

委托模版

问卷管理

用户管理

用户设置

保存

题目控件

问卷模版

下拉题

矩阵单选题

矩阵多选题

矩阵题

排序题

单行文本

多行文本

段落说明

表格题

附件题

滑块题

基金调查

第一页

请输入问卷标题

请输入问卷描述

展开题库

问卷分析功能：自动汇总问卷数据信息，支持截面数据的各种统计分析以及时间序列数据的统计分析

3. 产品基本信息

备注：规模部分可选填

基金	提交者	开始时间	结束时间	基金类型	投资策略
诚信量化多策略8期私募基金	<a href="#">分析报告</a> 安诚数盈投资	2016-08-22	至今	私募契约型	复合策略
千石雁丰多策略	<a href="#">分析报告</a> 上海雁丰投资管理有限公司	2014-06-16	至今	私募契约型	复合策略
雷根5号基金	<a href="#">分析报告</a> 雷根基金	2014-02-14	至今	私募契约型	股票多头
雷根6号基金	<a href="#">分析报告</a> 雷根基金	2014-02-10	至今	私募契约型	市场中性
雷根混合型基金	<a href="#">分析报告</a> 雷根基金	2015-09-18	至今	私募契约型	复合策略
通和进取1号投资基金	<a href="#">分析报告</a> 大连通和投资有限公司	2014-12-30	至今	私募契约型	复合策略
富享一期投资基金	<a href="#">分析报告</a> 大连通和投资有限公司	2015-12-17	至今	私募契约型	股票多头
中融通和量化对冲	<a href="#">分析报告</a> 大连通和投资有限公司	2013-09-17	至今	信托产品	市场中性
洪昌量子对冲1号私募证券投资基金	<a href="#">分析报告</a> 广东洪昌投资管理有限公司	2016-08-18	至今	私募契约型	市场中性

4. 产品补充信息

如有多支产品，请在以下表格中依次填写。

提交者	产品名称	最新净值日	最新累计净值	Wind代码	基金业协会编码	私募排序代码
上海雁丰投资管理有限公司	千石雁丰多策略2号	2015-08-18	1.0944		S80608	
上海雁丰投资管理有限公司	雁丰多策略对冲1号	2015-10-09	1.062		S82738	
雷根基金	雷根5号基金	now	2.3497	XT1412108	SH7670	S23995

平均值

Hao Sun <AB>

Alfonso Duval <Moneda>

Martin Coughlan <Westwood>

Kevin Liu <Aberdeen>

Yan Yang <Wellington>

请分享您对以下资产类别的12个月看法：

平均值

全部 <All>

况客科技 FOF 管理系统介绍

15

- 白雪亮 <Two Asset Management Co.,Ltd.>
- 张峻峰 <Three Asset Management Co.,Ltd.>
- 何冰冰 <Four Fund Management Co.,Ltd.>
- 管祥铭 <Eight Asset Management Co.,Ltd.>
- 邓婕 <Five Fund Management Co.,Ltd.>
- 陈晨 <Nine Asset Management Co., Ltd.>

管祥铭

平均值

