

0523巨远

2025年5月23日 13:41

厦门巨远优居全资控股子公司

总规模5000万，自营2000万

2基金经理，2IT，2资管，1运营

吕总负责套利类、另一个基金经理负责股票类

3只产品：去年11月、12月、今年2月开始有机构资金进入

1号纯套利：24年8月发行，预期收益8-10%，今年预期较好，费后8%左右，产品最大回撤1%，实际最大内控2%

2号加了多空：预期15%，回撤6%左右

3号证券公司专户，2000万，稳健低波同1号

6号股票高红利还在孵化

希望围绕1号产品完成对机构的募资

同步在做区块链量化，三家交易所的做市商

目标年底完成5000万-2亿规模增量，招募面向家办和高净的市场渠道

套利策略：

商品全品种统计套利，季节性套利、基本面因子作为补强，纯跨期，也有蝶套

实际持仓100+套利对，无敞口

板块根据行情、季节不同权重不同，限制单品种持仓，被套的情况也有

保证金20-40%

股票端ETF套利、打新做增强，

现在做的是SP合约，40多个，去掉一些，广期所做的少，合约都是快到期的

选择临近月份做，不是主力-次主力，90%做回归，提前在合适的价格挂单，被动成交，冻结保证金比较多

日频交易

后面规模达限，会加上没有SP的，在研究滑点控制

笃熙虞泰通道规模9亿

倾向专户，分散多家管理麻烦

按500投，最多给到1500，1：3