

MOM管理系统

齐鲁证券资管
QILU ASSET MANAGEMENT

首页

产品表现

资产分布风险

绩效分析

项目管理

估值表上传

项目名称	资产净值（万）	当日盈利	单位净值	累计净值	当日净值涨幅	更新时间			
星辰汇聚1号	¥ 600597476.00	¥ 938214.00	1.0010	1.0010	0.16%	20160607	详情	持仓	月报
星辰汇聚2号							详情	持仓	月报
星辰汇聚3号							详情	持仓	月报

- 1、“详情”按钮链接到“MOM产品分析页面”
- 2、“持仓”按钮链接到“MOM资产分布与暴露”
- 3、月报按钮导出最近一个月月报

星辰汇聚1号

项目名称	资产净值	当日盈利	调整后单位净值	累计净值	当日净值涨幅	年化收益率	最大回撤	夏普率	预警标志	更新时间		
富国	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓
中欧	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓
念空	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓
富善	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓

星辰汇聚2号

项目名称	资产净值	当日盈利	调整后单位净值	累计净值	当日净值涨幅	年化收益率	最大回撤	夏普率	预警标志	更新时间		
华夏	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓
易方达	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓
南方	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓
博时	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓

星辰汇聚3号

项目名称	资产净值	当日盈利	调整后单位净值	累计净值	当日净值涨幅	年化收益率	最大回撤	夏普率	预警标志	更新时间		
嘉实	¥ 10008946	¥ 6817.00	1.0009	1.0011	0.05%	20%	-0.27%	-2.47	正常	20160606	详情	持仓

项目:

星辰汇聚1号

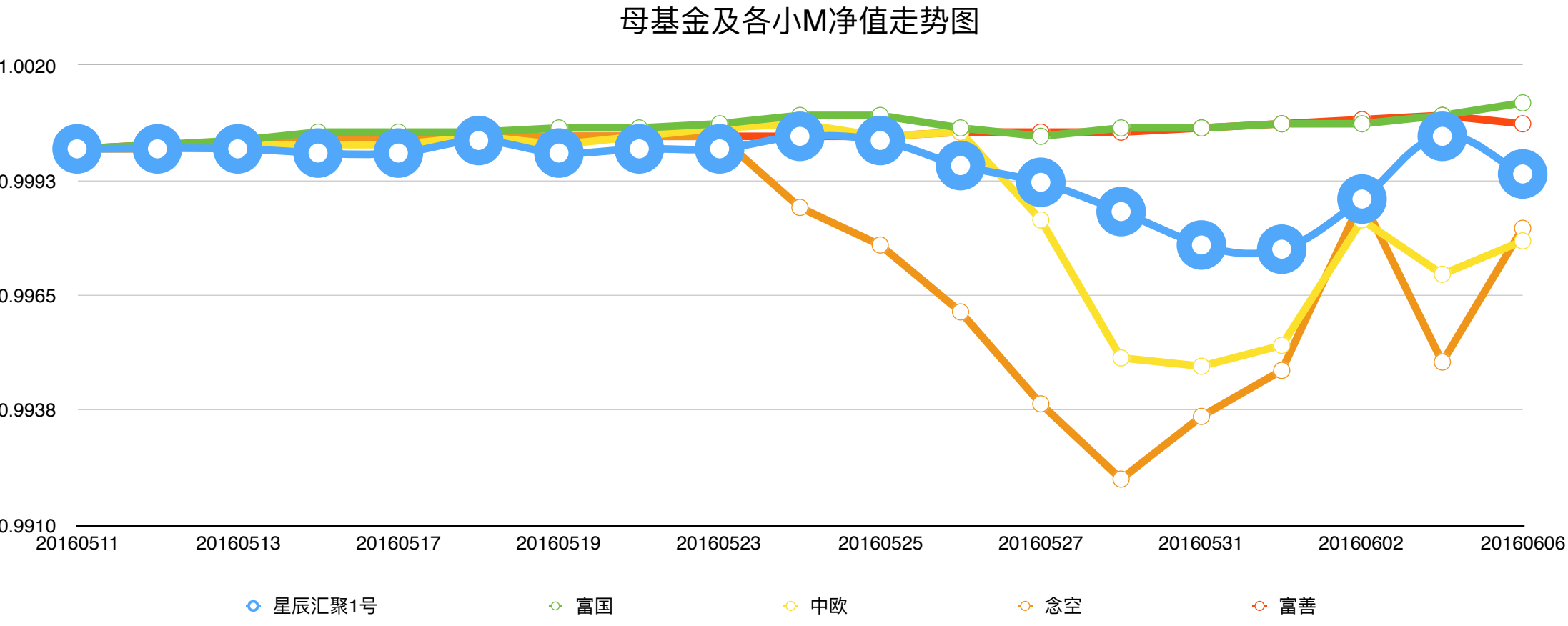
开始日期:

20160511

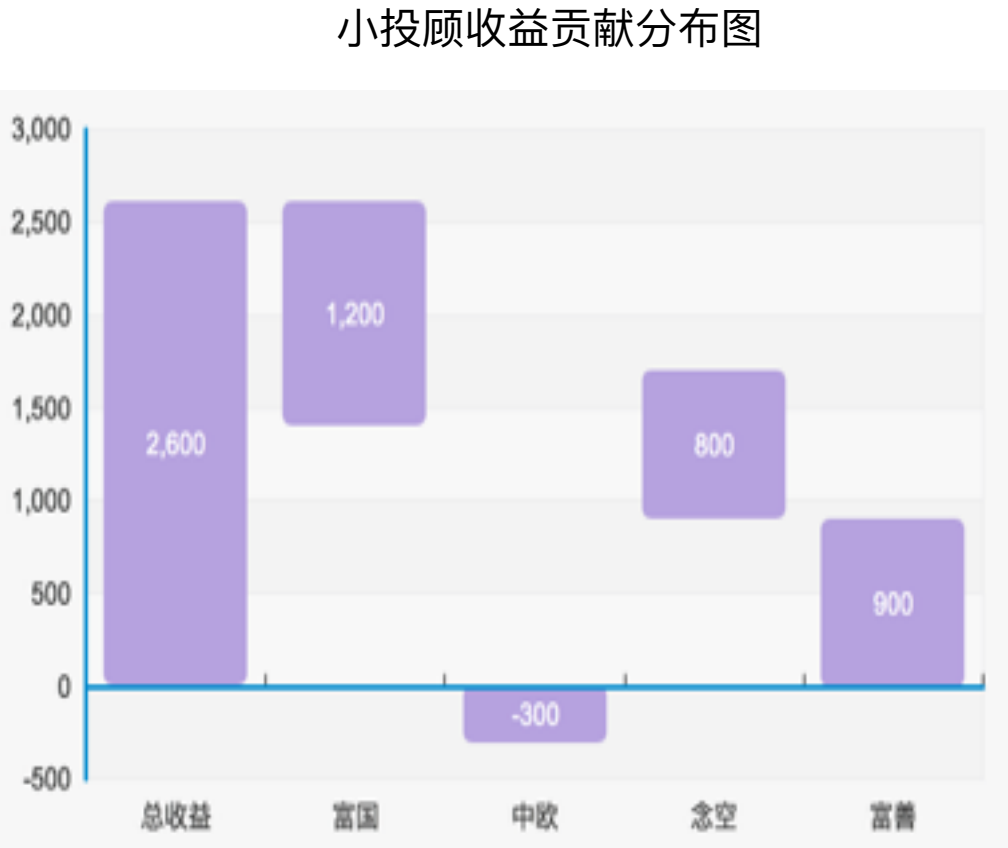
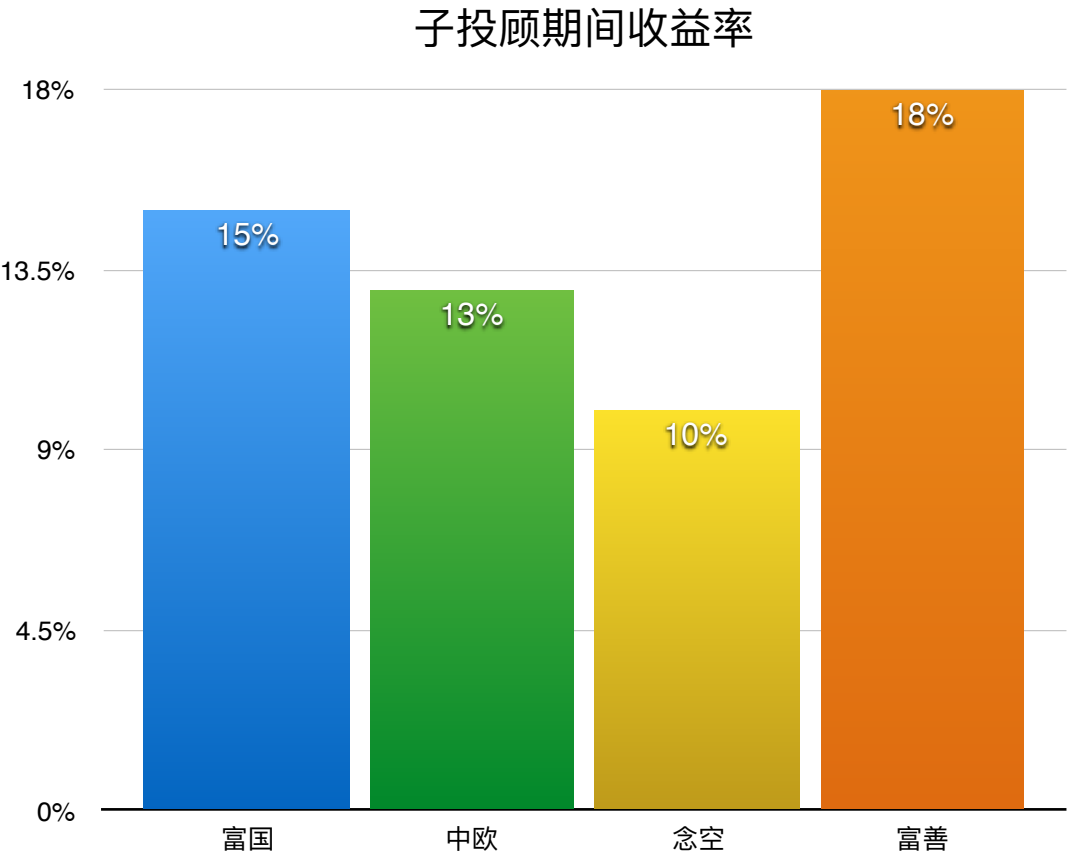
结束日期:

20160606

查询



回报	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
2015年				1.4%	2.2%	-1.2%	-0.4%	1%	1.3%	1.1%	0.5%	2.2%
2016年	0.6%	1.2%	2%	2.3%	-2.3%	1.2%						



该页面可以查询到所有在“MOM项目管理”中维护的产品和产品组合

开始日期：默认为产品成立日期
结束日期：默认为today

净值表					
	星辰汇聚1号	富国	中欧	念空	富善
2016051	1.0000	1.0000		1.0000	1.0000
2016051	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
2016051	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
2016051	0.9999	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
2016051	0.9999	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
2016051	1.0002	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
2016051	0.9999	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
2016052	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
2016052	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
2016052	1.0003	1.0000	1.0000	0.9998	1.0000
2016052	1.0002	1.0000	1.0000	0.9977	1.0000
2016052	0.9996	1.0000	1.0000	0.9961	1.0000
2016052	0.9992	1.0000	0.9980	0.9930	1.0000
2016053	0.9985	1.0000	0.9950	0.9921	1.0000
2016053	0.9977	1.0000	0.9940	0.9930	1.0000
2016060	0.9976	1.0000	0.9950	0.9941	1.0000
2016060	0.9988	1.0000	0.9980	0.9980	1.0000
2016060	1.0003	1.0000	0.9970	0.9940	1.0000
2016060	0.9994	1.0011	0.9970	0.9981	1.0000
2016060	1.0010				

小投顾收益贡献比			
富国	中欧	念空	富善
23%	22%	39%	16%

小投顾期间收益率			
富国	中欧	念空	富善
15%	13%	10%	18%

基本数据

规模数据

当前规模	6000万	期间最大规模	6000万	期间最小规模	6000万
------	-------	--------	-------	--------	-------

收益率数据

绝对收益率	0.1%	年化收益率	1.25%	日收益率平均值	0.01%
最近3个月收益率		最近6个月收益率		最近12个月收益率	

回撤数据

最大回撤	-0.27%	最大回撤回复时间	8日		
最近3个月MDD		最近6个月MDD		最近12个月MDD	

风险收益数据

夏普率	-0.27%	提诺索比率	-0.27%	Calmar比率	5.6	年化波动率	2.3%
下行风险	1.5%	偏度	0.9	峰度	5.3	30日累计Beta值	待确认算法

相关性数据

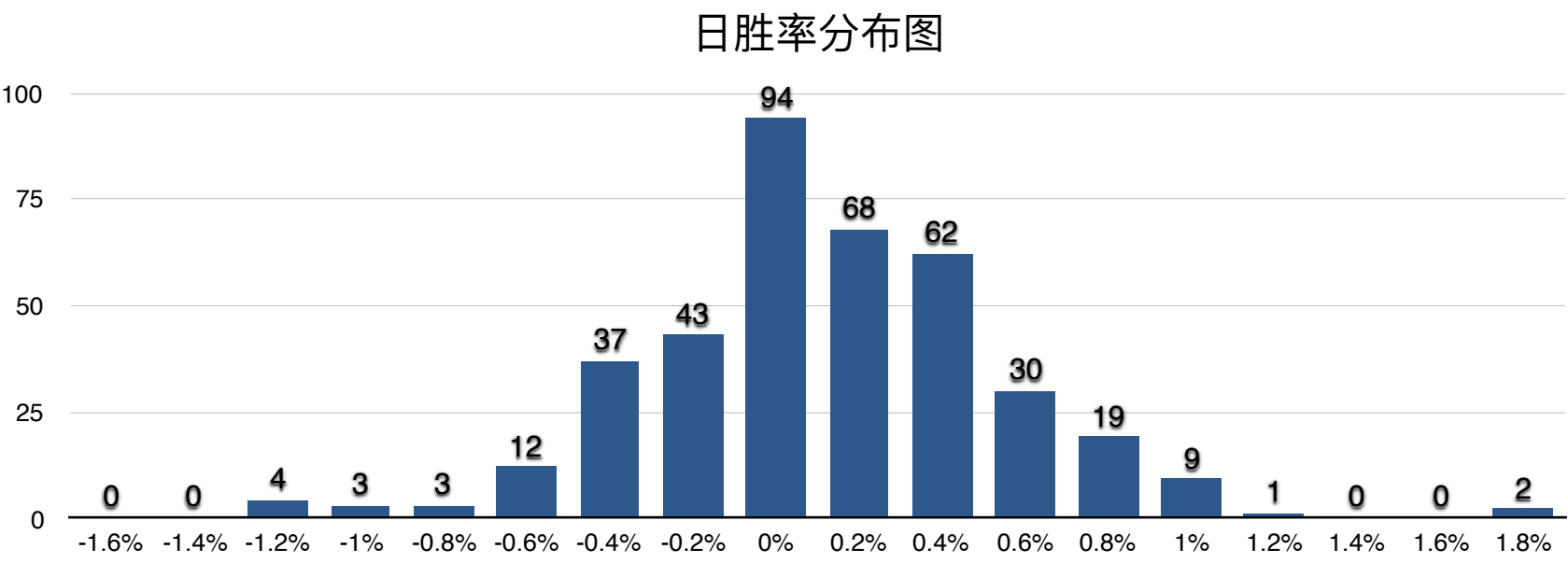
相关性	上证50	沪深300	中证500	500-300	商品指数
	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%
Beta	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%

日胜率分布图

-1.6%	0
-1.4%	0
-1.2%	4
-1%	3
-0.8%	3
-0.6%	12
-0.4%	37
-0.2%	43
0%	94
0.2%	68
0.4%	62

商品指数CCFI指数在wind中未更新，考虑直接与重要商品标的计算相关性

胜率



日胜率
1.5%
周胜率
1.5%
月胜率
1.5%

0.6%	30
0.8%	19
1%	9
1.2%	1
1.4%	0
1.6%	0
1.8%	2

小M展示

☒ 全选

☒ 富国

☒ 中欧

☒ 念空

☒ 富善

该复选框对下面三个表格同时有效

	富国	中欧	念空	富善
成立时间	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%
结束时间	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%
最近3个月收益率				
最近6个月收益率				
最近12个月收益率				
最近3个月MDD				
最近6个月MDD				
最近12个月MDD				
最大MDD回复时间				
最近12个月夏普率				
最近12个月Calmar比率				
最近12个月日胜率				
最近12个月周胜率				
最近12个月月胜率				

相关性矩阵

	富国	中欧	念空	富善
富国	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%
中欧	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%
念空				
富善				

Beta矩阵

	富国	中欧	念空	富善
富国	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%
中欧	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%
念空				
富善				

项目：

富善投资

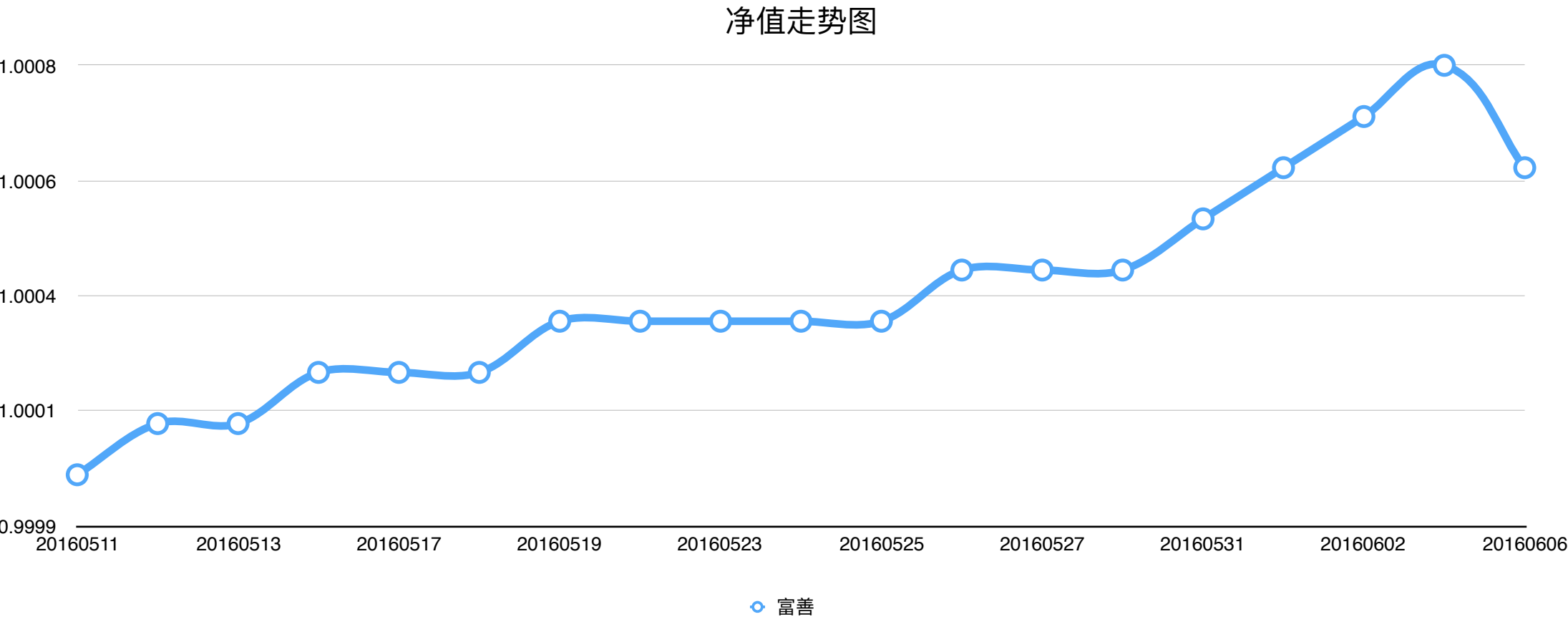
开始日期：

20160511

结束日期：

20160606

查询



回报	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
2015年				1.4%	2.2%	-1.2%	-0.4%	1%	1.3%	1.1%	0.5%	2.2%
2016年	0.6%	1.2%	2%	2.3%	-2.3%	1.2%						

基本数据

规模数据

当前规模	6000万	期间最大规模	6000万	期间最小规模	6000万
------	-------	--------	-------	--------	-------

收益率数据

绝对收益率	0.1%	年化收益率	1.25%	日收益率平均值	0.01%
最近3个月收益率		最近6个月收益率		最近12个月收益率	

回撤数据

最大回撤	-0.27%	最大回撤回复时间	8日		
最近3个月MDD		最近6个月MDD		最近12个月MDD	

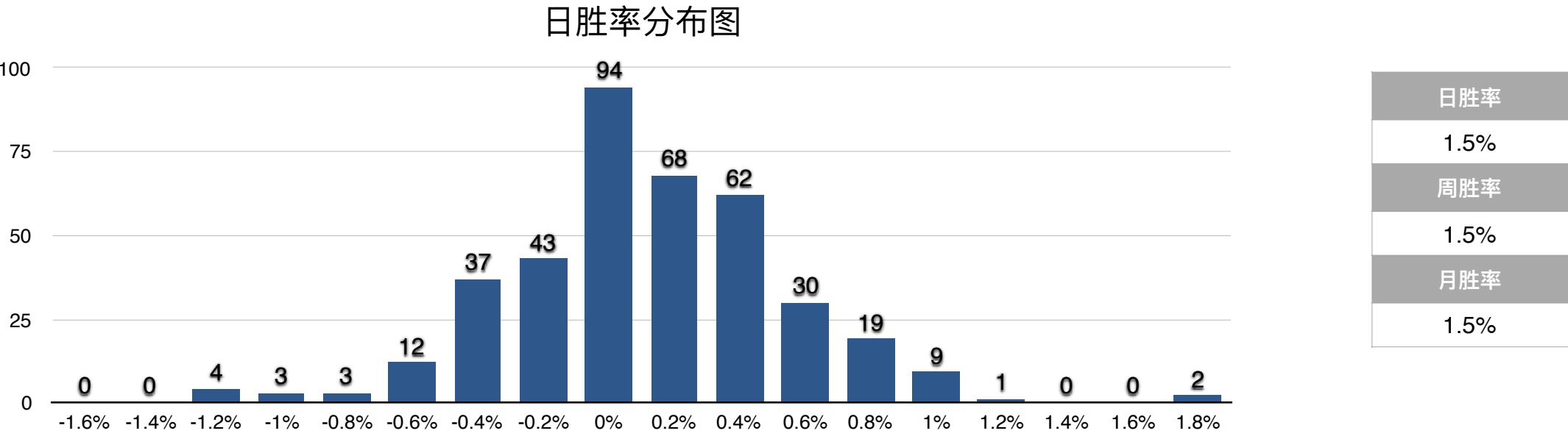
风险收益数据

夏普率	-0.27%	提诺索比率	-0.27%	Calmar比率	5.6	年化波动率	2.3%
下行风险	1.5%	偏度	0.9	峰度	5.3	30日累计Beta值	

相关性数据

	上证50	沪深300	中证500	500-300	商品指数
相关性	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%
Beta	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%	1.5%

胜率



该页面可以查询到所有在“MOM项目管理”中维护的产品和产品组合

开始日期：默认为产品成立日期
结束日期：默认为today

净值表

	富善
20160511	1.0000
20160512	1.0001
20160513	1.0001
20160516	1.0002
20160517	1.0002
20160518	1.0002
20160519	1.0003
20160520	1.0003
20160523	1.0003
20160524	1.0003
20160525	1.0003
20160526	1.0004
20160527	1.0004
20160530	1.0004
20160531	1.0005
20160601	1.0006
20160602	1.0007
20160603	1.0008
20160606	1.0006
20160607	

商品指数CCFI指数在wind中未更新，考虑直接与重要商品标的计算相关性

日胜率分布图

-1.6%	0
-1.4%	0
-1.2%	4
-1%	3
-0.8%	3
-0.6%	12
-0.4%	37
-0.2%	43
0%	94
0.2%	68
0.4%	62
0.6%	30
0.8%	19
1%	9
1.2%	1
1.4%	0
1.6%	0
1.8%	2

齐鲁证券资管
QILU ASSET MANAGEMENT

该页面只能看见已经投产的MOM项目，比如星辰汇聚1号

[首页](#)

MOM产品分析

MOM资产分布与暴露

MOM绩效分析

MOM项目管理

直表上传

项目：

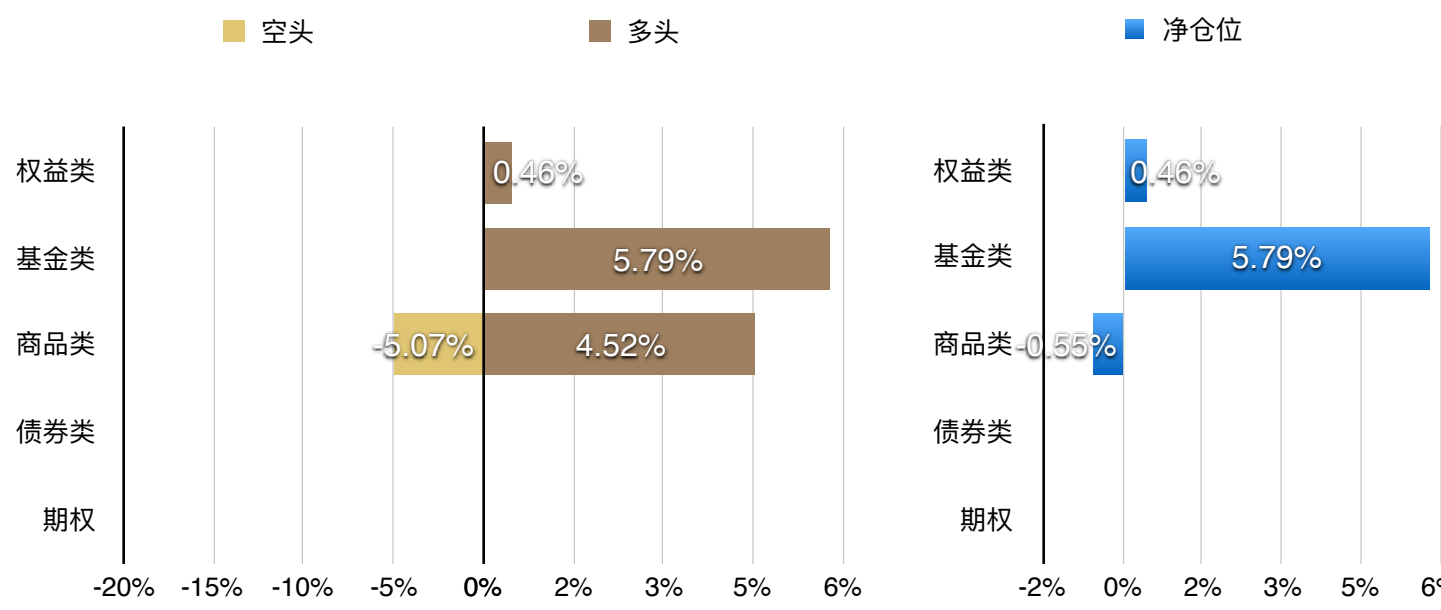
富国基金

日期：

20160606

查询

总资产仓位展示图



富国-总资产仓位数据表

	多头	空头	净仓位
权益类	0.46%		0.46%
基金类	5.79%		5.79%
商品类	4.52%	(5.07%)	(0.55%)
债券类			
期权			
总计	10.77%	(5.07%)	5.70%

图表说明：

权益类多头 = 股票现货 + 股指期货多头

权益类空头 = 股指期货空头 + 融券 (如有)

基金类多头 = 除货币基金

多头重仓持有标的 Top 5

资产类别	证券代码	标的名称	占净值比例	流动性占比
基金	161812	100分级	0.81%	
商品期货	RB1610	螺纹钢1610	0.72%	
基金	160222	国泰食品	0.61%	
基金	165312	建信50	0.55%	
商品期货	011609	铁矿石1609	0.48%	

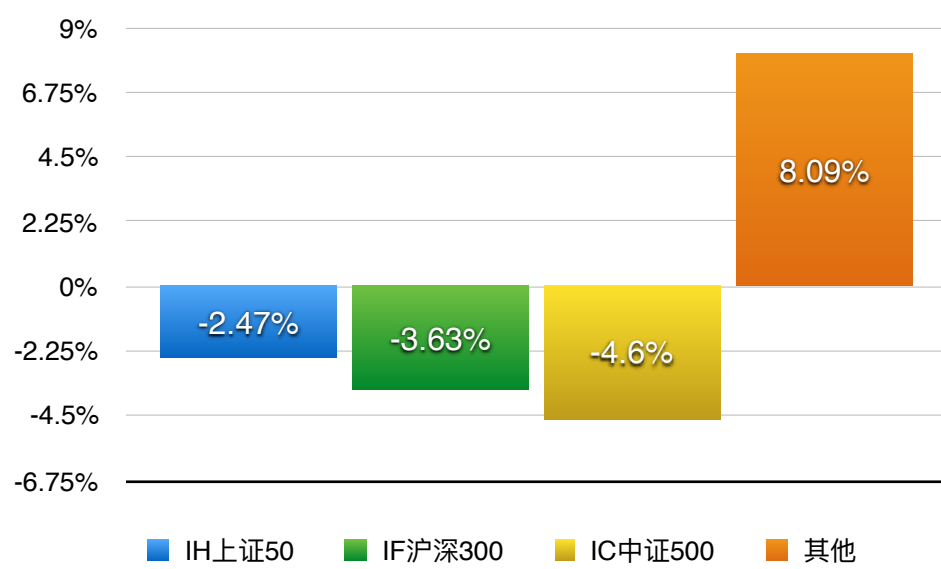
空头重仓持有标的 Top 5

资产类别	证券代码	标的名称	占净值比例	流动性占比
股指期货	IF1606	IF1606	-5.17%	
股指期货	IC1606	IC1606	-4.33%	
股指期货	IC1609	IC1609	-2.48%	
股指期货	IH1606	IH1606	-0.83%	
股指期货	IC1607	IC1607	58.00%	

图表说明：流动性占比 = 该品种交易市值 / 当日成交额

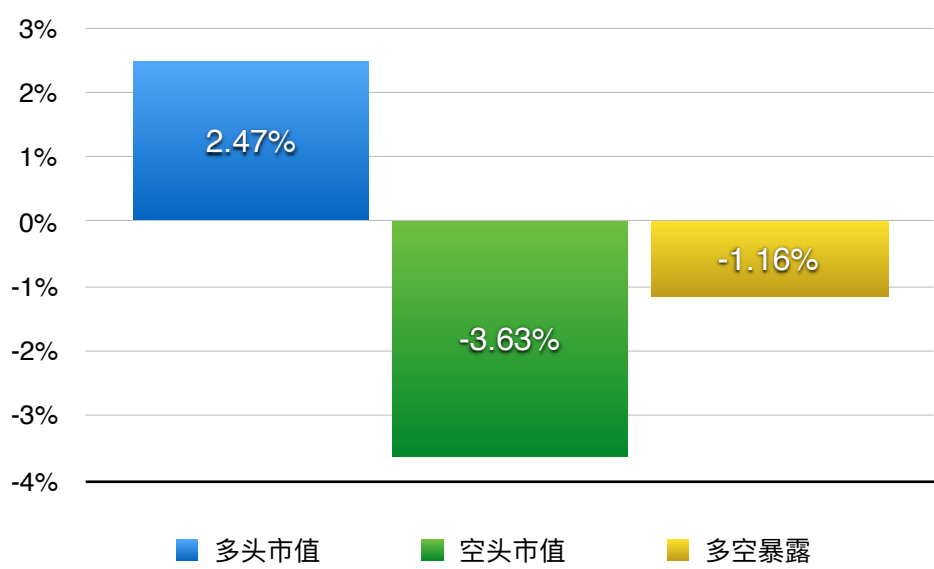
权益类

风格暴露



图表说明：股指期货成分股分拆后与股票合并后计算风格暴露

市值暴露



图表说明：多头 = 股票现货 + 股指期货多头
空头 = 股指期货空头 + 融券（如有）

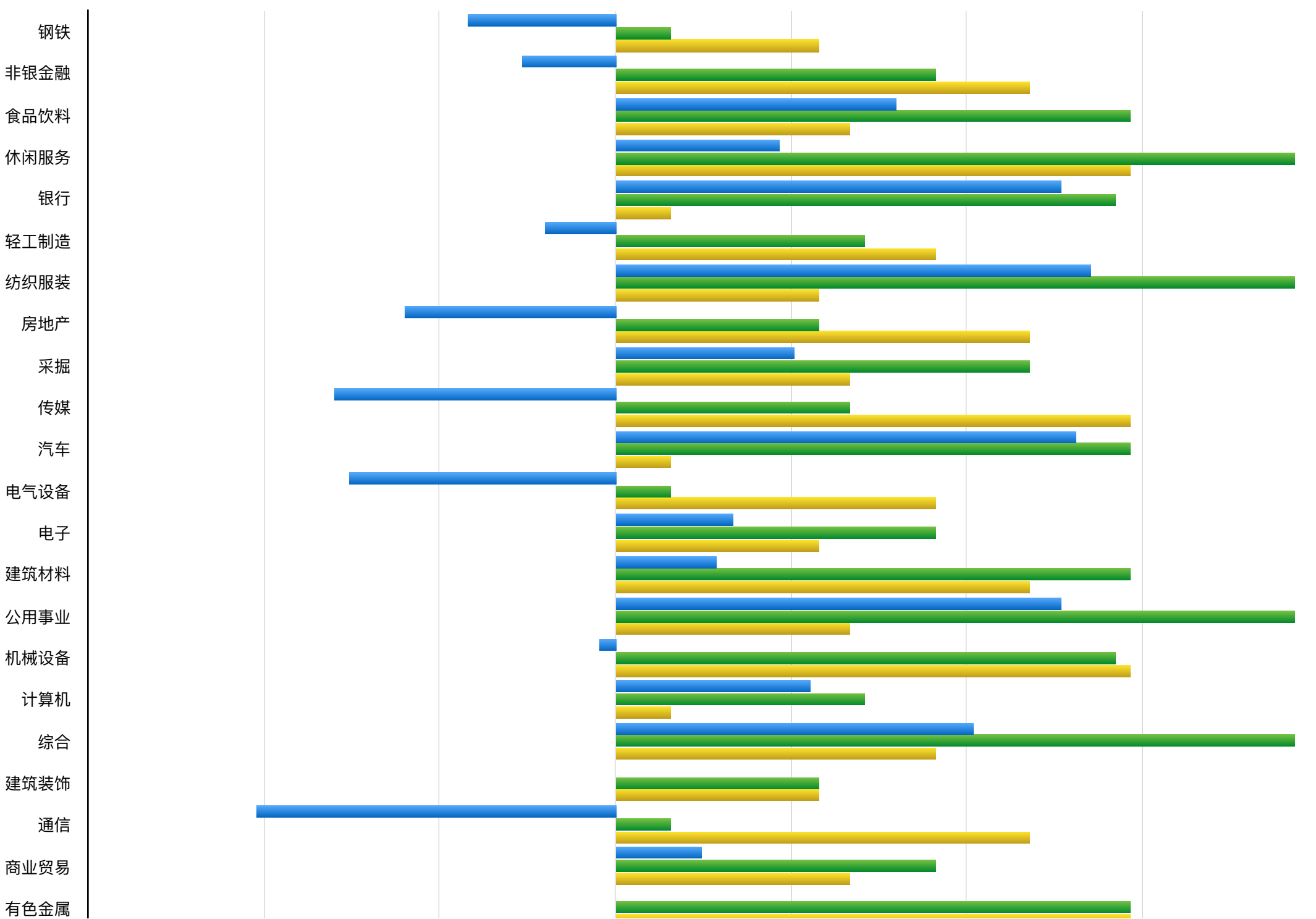
风格暴露

	风格暴露
IH上证50	-2.47%
IF沪深300	-3.63%
IC中证500	-4.6%
其他	8.09%

市值暴露

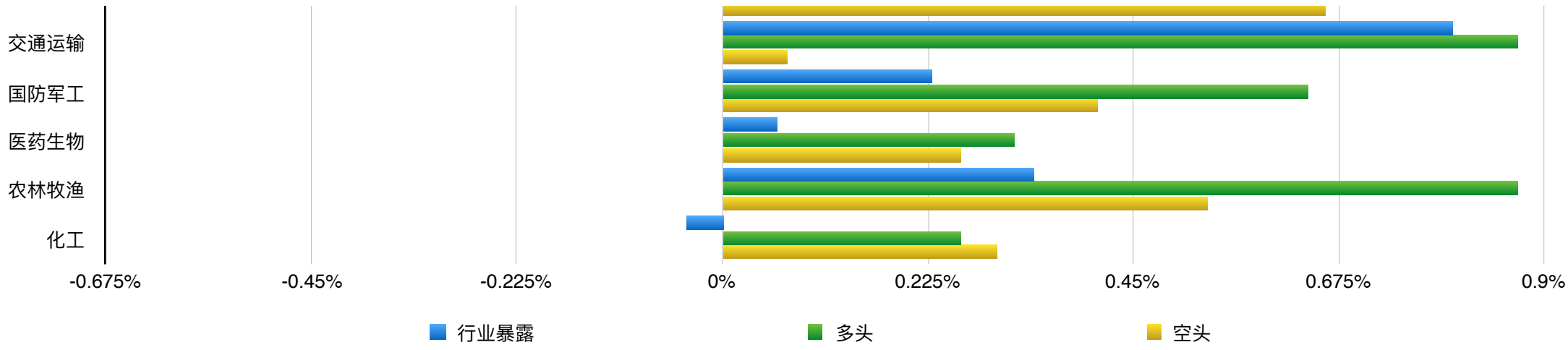
	市值暴露
多头市值	2.47%
空头市值	-3.63%
多空暴露	-1.16%

行业暴露



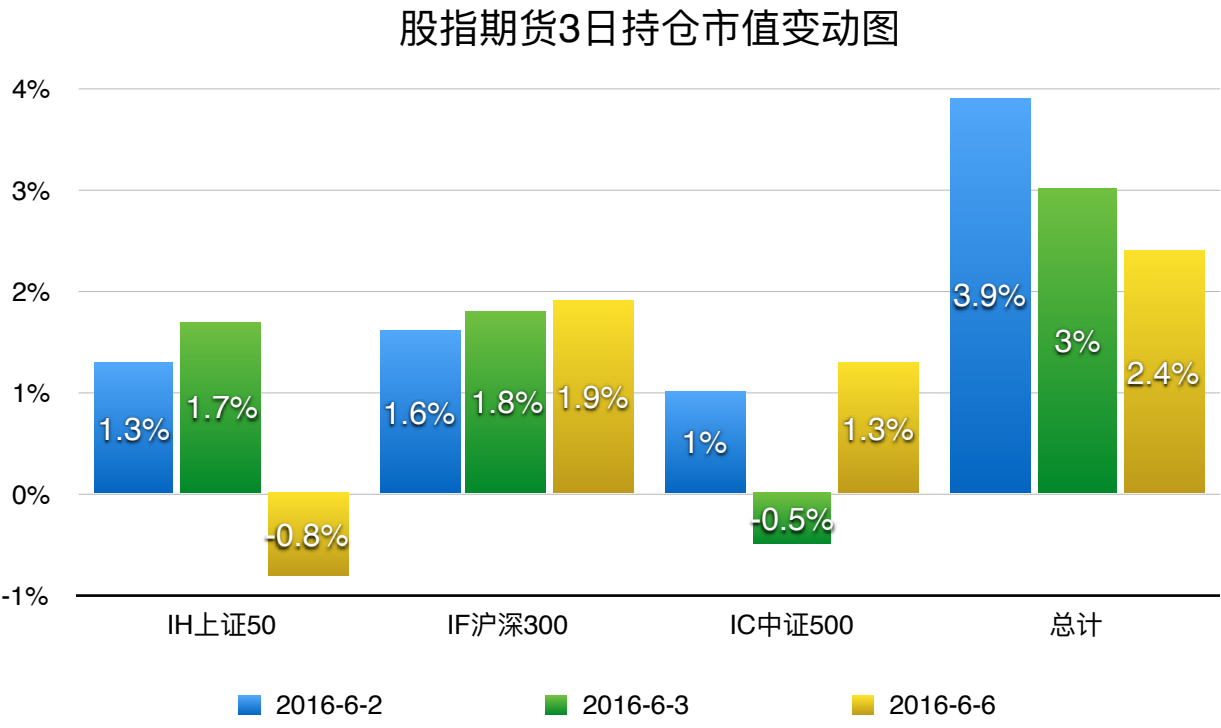
行业暴露

	行业暴露	多头	空头
钢铁	-0.19%	0.07%	0.26%
非银金融	-0.12%	0.41%	0.53%
食品饮料	0.36%	0.66%	0.3%
休闲服务	0.21%	0.87%	0.66%
银行	0.57%	0.64%	0.07%
轻工制造	-0.09%	0.32%	0.41%
纺织服装	0.61%	0.87%	0.26%
房地产	-0.27%	0.26%	0.53%
采掘	0.23%	0.53%	0.3%
传媒	-0.36%	0.3%	0.66%
汽车	0.59%	0.66%	0.07%
电气设备	-0.34%	0.07%	0.41%
电子	0.15%	0.41%	0.26%
建筑材料	0.13%	0.66%	0.53%
公用事业	0.57%	0.87%	0.3%
机械设备	-0.02%	0.64%	0.66%
计算机	0.25%	0.32%	0.07%
综合	0.46%	0.87%	0.41%
建筑装饰	0%	0.26%	0.26%
通信	-0.46%	0.07%	0.53%
商业贸易	0.11%	0.41%	0.3%



“行业暴露”图表说明：股指期货拆分后与股票现货合并计算

	行业暴露	多头	空头
有色金属	0%	0.66%	0.66%
交通运输	0.8%	0.87%	0.07%
国防军工	0.23%	0.64%	0.41%
医药生物	0.06%	0.32%	0.26%
农林牧渔	0.34%	0.87%	0.53%
化工	-0.04%	0.26%	0.3%



股票现货持仓总市值占比	股票现货品种数量	单一股票平均持仓占比
0.4625%	30	0.0154%

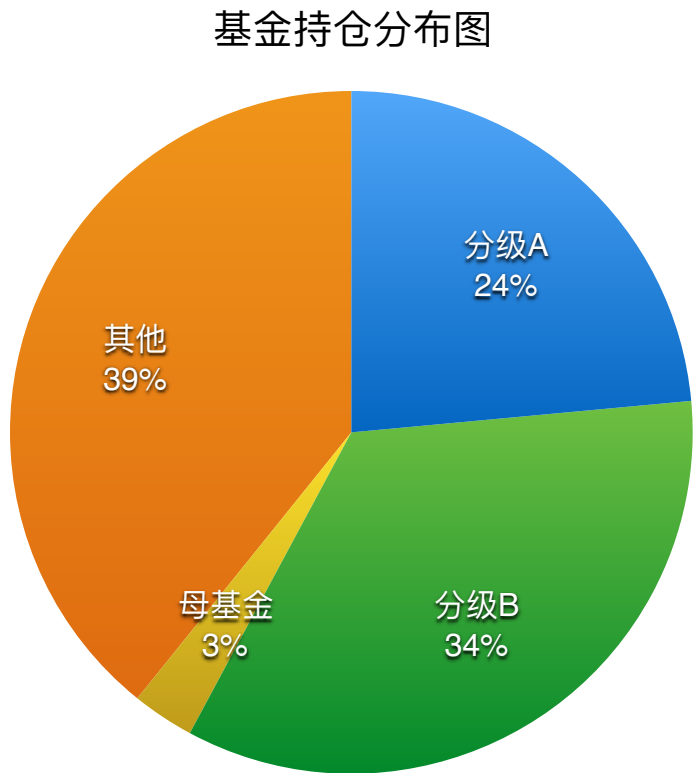
证券代码	标的名称	占净值比例	流动性占比
000001	平安银行	2.50%	
000008	神州高铁	2.30%	
000650	仁和药业	2.10%	
600505	西昌电力	1.40%	
300002	神州泰岳	1.20%	

图表说明：流动性占比 = 该品种交易市值 / 当日成交额

	2016-6-2	2016-6-3	2016-6-6
IH上证50	1.3%	1.7%	-0.8%
IF沪深300	1.6%	1.8%	1.9%
IC中证500	1%	-0.5%	1.3%
总计	3.9%	3%	2.4%

基金类

基金持仓分布饼图



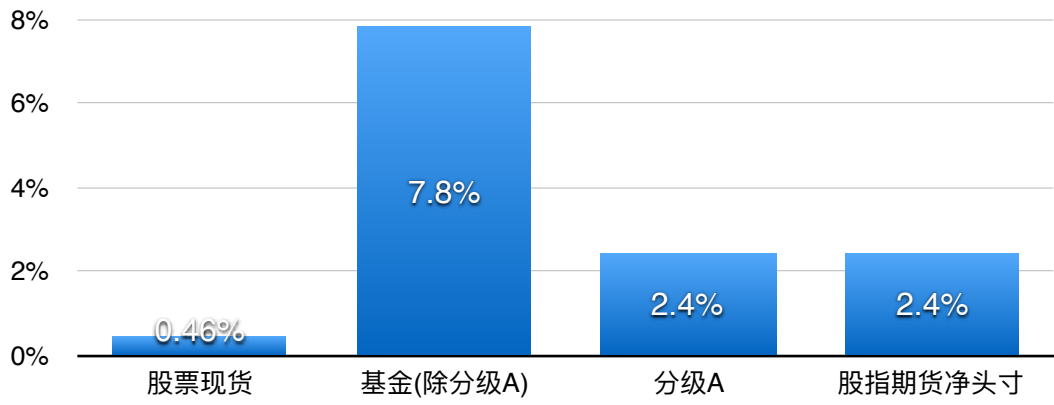
基金持仓市值占净值比例表

分级A	分级B	母基金	其他	总计持仓
2.4%	3.50%	0.30%	4.00%	10.20%

分级A与权益类资产占比

股票现货	基金(除分)	分级A	股指期货净头寸
0.46%	7.8%	2.40%	2.40%

分级A与权益类资产占净值比例图



图表说明：以上基金投资的所有计算均不包含货币基金

商品期货类

富国-商品期货板块持仓头寸

	多头	空头	净仓位	仓位绝对	仓位绝对
贵金属	0.46%	0.00%	0.46%	0.46%	1.39%
有色金属	5.79%	0.00%	5.79%	5.79%	17.42%
建材	4.52%	-5.07%	-0.55%	5.61%	16.89%
焦煤钢矿	1.50%	0.00%	1.50%	1.50%	4.52%
化工	0.46%	0.00%	0.46%	0.46%	1.39%
能源	5.79%	0.00%	5.79%	5.79%	17.42%
油脂油料	4.52%	-5.07%	-0.55%	5.61%	16.89%
谷物	2.40%	-2.00%	0.40%	1.60%	4.82%
软商品	3.00%	-1.90%	1.10%	0.80%	2.41%
农副产品	15.00%	-4.70%	10.30%	5.60%	16.86%
总计	43.44%	-18.73%	24.71%	33.22%	100.00%

合约持仓占比

黄金	铜	玻璃	螺纹	橡胶	动力	菜粕	强麦	白糖	鸡蛋
1.02%	6.16%	12.41%	3.32%	11.00%	12.80%	12.41%	3.54%	1.77%	25.56%

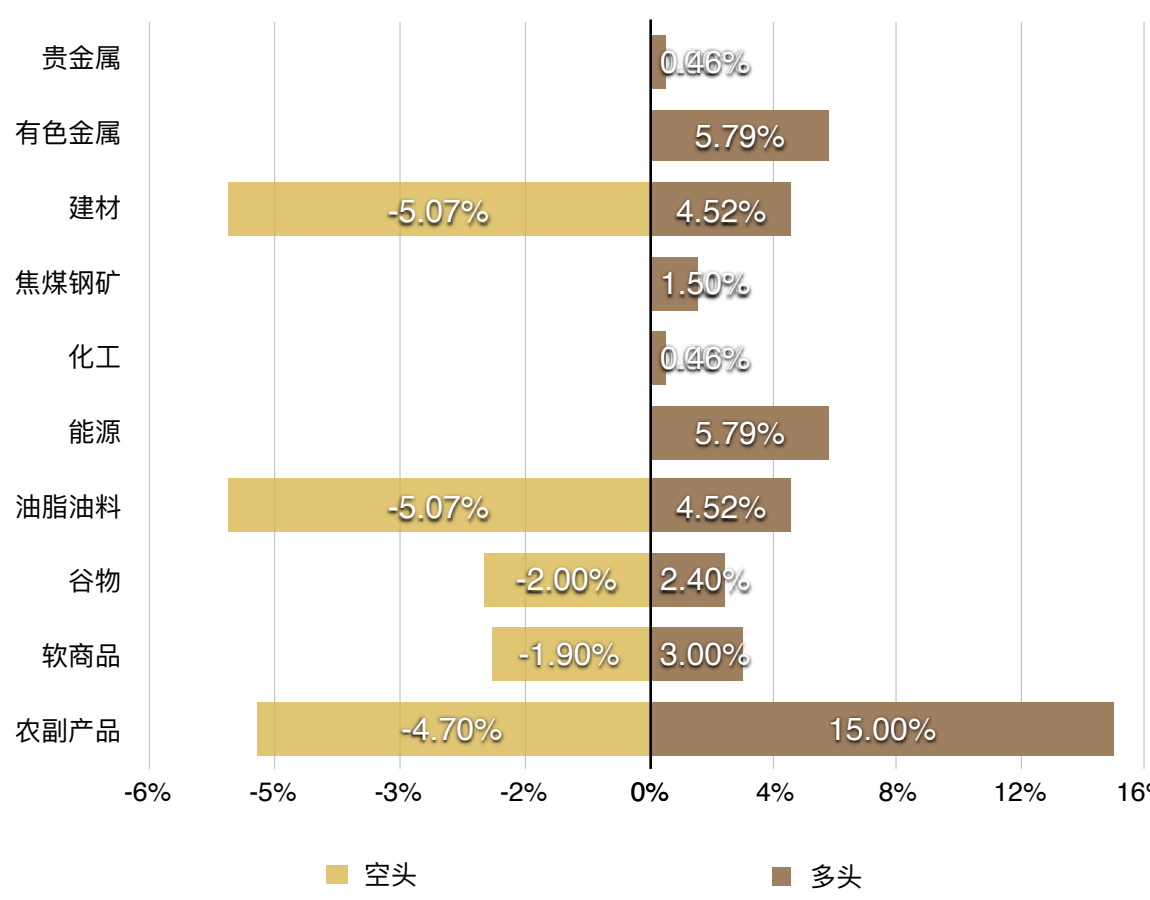
板块持仓占比

贵金	有色	建材	焦煤	化工	能源	油脂	谷物	软商	农副
1.02%	6.16%	12.41%	3.32%	1.02%	12.80%	12.41%	3.54%	1.77%	45.56%

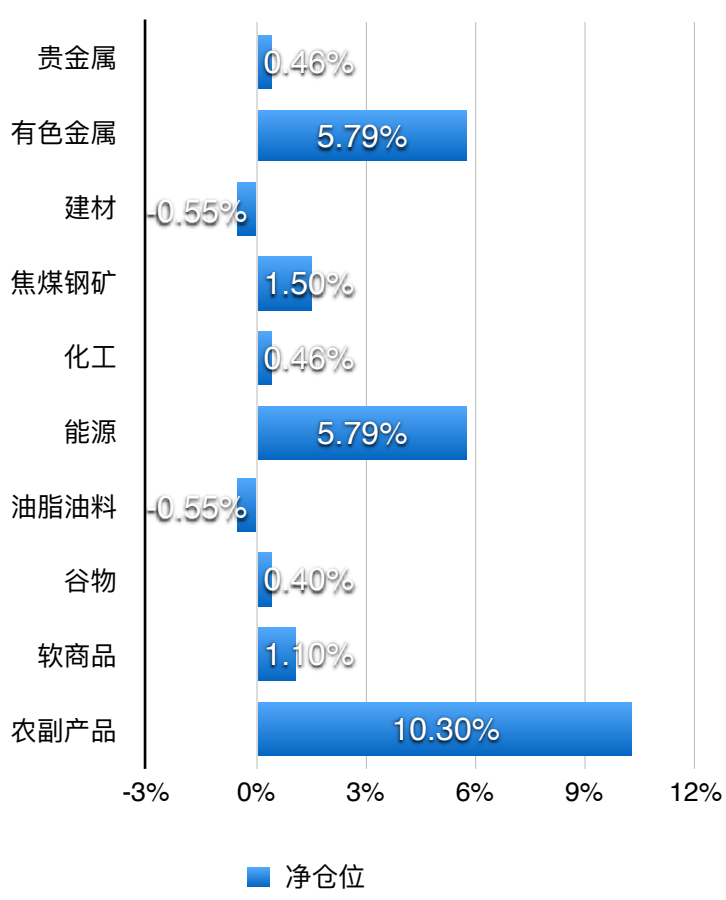
板块持仓头寸三日变动图

	20160603	20160603	20160606
有色金属	5.79%	0.00%	5.79%
建材	4.52%	-5.07%	-0.55%
焦煤钢矿	1.50%	0.00%	1.50%
化工	0.46%	0.00%	0.46%
能源	5.79%	0.00%	5.79%
油脂油料	4.52%	-5.07%	-0.55%
谷物	2.40%	-2.00%	0.40%
软商品	3.00%	-1.90%	1.10%

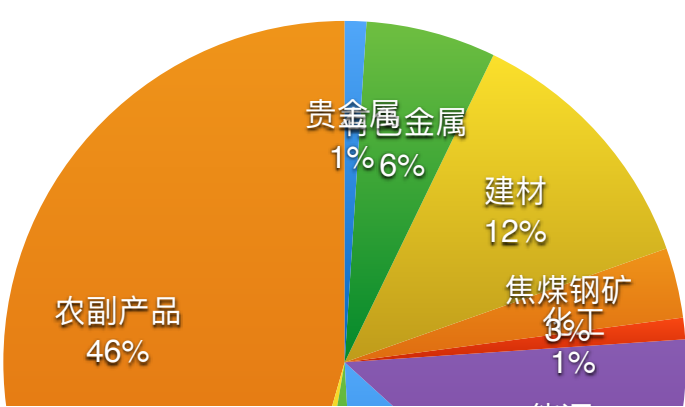
板块持仓多空对比图（暴露）



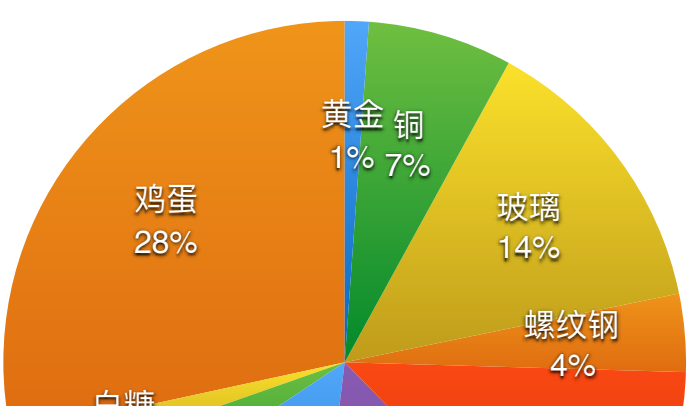
板块持仓净仓位图（暴露）

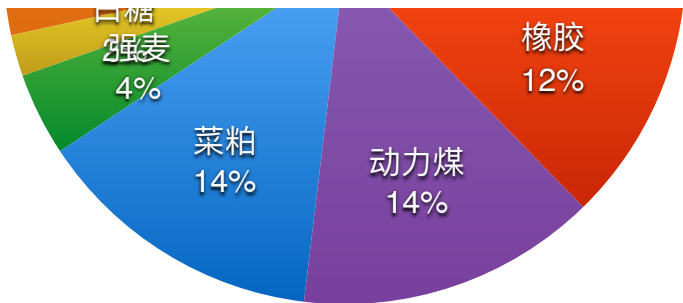
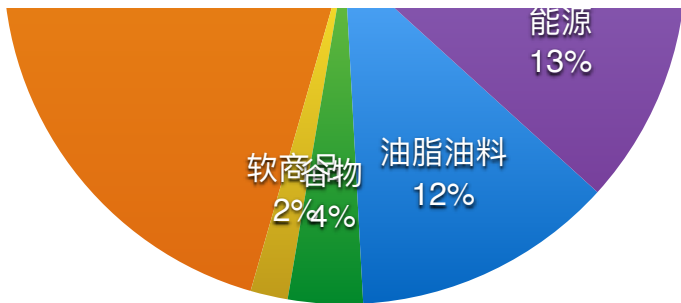


板块持仓占比（分散性）



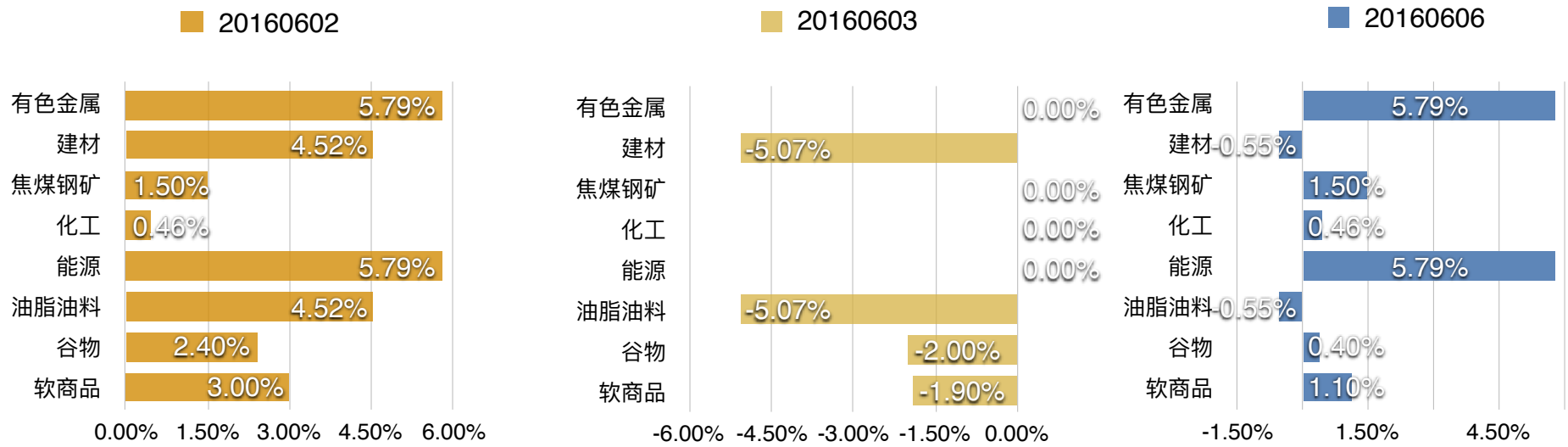
合约持仓占比（分散性）



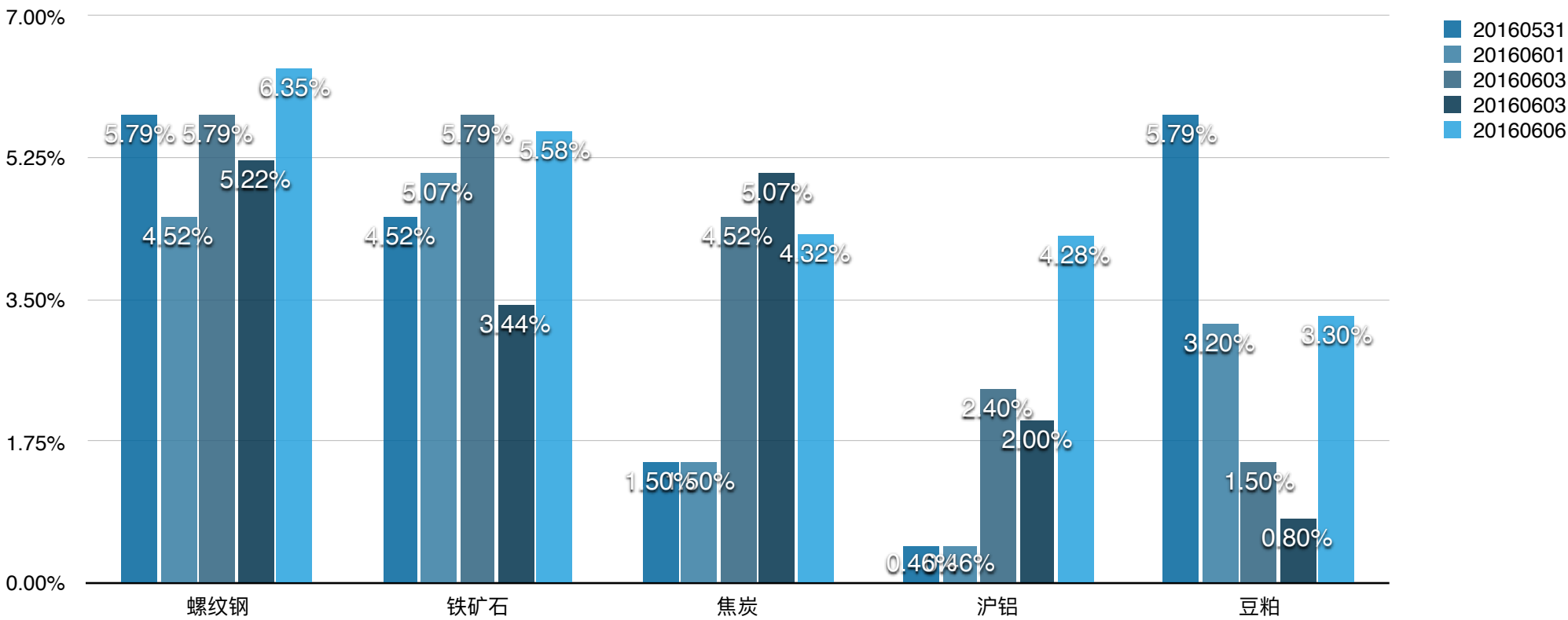


饼图能够比较直观地展示持仓的分散性，此处也可以使用嵌套饼图合并为一个图

板块净持仓头寸三日变动图



单一期货品种净持仓头寸（Top 5）五日变动图（展示趋势性仓位）



图表说明：以T日持仓为准，计算净头寸Top 5 的期货品种

总计	27.98%	-14.03%	13.94%
----	--------	---------	--------

商品期货板块分类		
分类	代码	品种名称
非金属建材	TC.CZC	CZCE玻璃
非金属建材	V.DCE	DCE PVC
非金属建材	BB	胶合板
非金属建材	fb	纤维板
谷物	C.DCE	DCE玉米
谷物	CS.DCE	DCE玉米淀粉
谷物	WH.CZC	CZCE强麦
谷物	jr	粳稻
谷物	lr	晚籼稻
谷物	pm	普麦
谷物	ri	早籼稻
贵金属	AG.SHF	SHFE白银
贵金属	AU.SHF	SHFE黄金
化工	PP.DCE	DCE聚丙烯
化工	L.DCE	DCE塑料
化工	MA.CZC	CZCE甲醇
化工	TA.CZC	CZCE PTA
化工	BU.SHF	SHFE沥青
化工	RU.SHF	SHFE橡胶
焦煤钢矿	RB.SHF	SHFE螺纹钢
焦煤钢矿	I.DCE	DCE铁矿石
焦煤钢矿	HC.SHF	SHFE热轧卷板
焦煤钢矿	J.DCE	DCE焦炭
焦煤钢矿	JM.DCE	DCE焦煤
焦煤钢矿	SF	铁
焦煤钢矿	sm	硅
焦煤钢矿	wr	线材
能源	FG.CZC	CZCE动力煤
能源	fu	燃油
农副产品	JD.DCE	DCE鸡蛋
软商品	CF.CZC	CZCE棉花
软商品	SR.CZC	CZCE白糖
油脂油料	A.DCE	DCE豆一
油脂油料	M.DCE	DCE豆粕
油脂油料	Y.DCE	DCE豆油
油脂油料	OI.CZC	CZCE菜油
油脂油料	RM.CZC	CZCE菜粕
油脂油料	P.DCE	DCE棕榈油
油脂油料	B	豆二
油脂油料	rs	菜籽
有色金属	AL.SHF	SHFE铝
有色金属	CU.SHF	SHFE铜
有色金属	NI.SHF	SHFE镍
有色金属	PB.SHF	SHFE铅
有色金属	SN.SHF	SHFE锡
有色金属	ZN.SHF	SHFE锌

螺纹钢合约净持仓头寸 Top 5 五日变动图

	20160531	20160601	20160603	20160603	20160606
螺纹钢	5.79%	4.52%	5.79%	5.22%	6.35%
铁矿石	4.52%	5.07%	5.79%	3.44%	5.58%
焦炭	1.50%	1.50%	4.52%	5.07%	4.32%
沪铝	0.46%	0.46%	2.40%	2.00%	4.28%
豆粕	5.79%	3.20%	1.50%	0.80%	3.30%

MOM管理系统

齐鲁证券资管
QILU ASSET MANAGEMENT

首页

MOM产品分析

MOM资产分布与
暴露

MOM绩效分析

MOM项目管理

估值表上传

项目：

富国基金

开始日期：

20160511

结束日期：

20160606

查询

开始日期：默认为产品成立日期

结束日期：默认为today

后续请小M提供月报以展示分策略的绩效，这里汇总展示

MOM管理系统

齐鲁证券资管
QILU ASSET MANAGEMENT

首页

MOM产品分析

MOM资产分布与暴露

MOM绩效分析

MOM项目管理

估值表上传

添加项目：

添加项目

备案号	以基金业协会的备案号码为准，没有的，可自行编码，后续修改
项目名称	
项目级别	三层结构，例如星辰汇聚1号为第一层，富善投资产品为第三层
产品类型	基金专户、券商资管集合、私募基金等
机构名称	实际管理人，通常为管理人或投顾
管理人	合同中的名义管理人
托管人	
项目成立日期	
预警线	合同中的预警线
止损线	合同中的止损线
回撤控制要求	文本
管理费率	
托管费率	
运营服务费率	
业绩报酬	
项目介绍	

保存 放弃

项目结构：

一级项目

星辰汇聚1号

二级项目

MOM1号

查询&编辑

名称	规模	操作
富国基金浦银量化对冲1号资产管理计划	100000000	删除
中欧基金浦银量化对冲1号资产管理计划	100000000	删除
星辰之念空多策略证券投资基金	100000000	删除
星辰之富善多策略证券投资基金	100000000	删除
下拉框选择项目	文本框中输入规模	保存 放弃
添加项目		

项目列表

代码	层级结构	操作	备注
8	大M	星辰汇聚1号	生产
6	大M	测试大M	测试
10004	逻辑层	MOM1号	生产
10005	逻辑层	测试逻辑层第一层	测试
10006	逻辑层	测试逻辑层第二层	测试
10000036	小M	富国基金浦银量化对冲1号资产管理计划	生产
10000037	小M	中欧基金浦银量化对冲1号资产管理计划	生产
10000038	小M	星辰之念空多策略证券投资基金	生产
10000039	小M	星辰之富善多策略证券投资基金	生产
10000043	小M	银华基金-专户A	测试
10000044	小M	银华基金-专户B	测试

导入净值

项目名称:

银华基金-专户A

上传净值文件:

本地上传特定格式文件

导入净值

导入净值并不删除存在的净值，而是以新增的方式添加

编辑净值

项目名称:

银华基金-专户A

查询净值

标准日期	星期	日净值	周净值	月净值	操作		
20160529	5	1	1		填写日净值	插入	放弃
20160530	1	0.9999					
20160531	2	0.9998		0.9998			
20160601	3	1					
20160602	4	0.9988					
20160603	5	1.0003	1.003				
20160606	1	0.9994					
20160607	2	1.0010					
20160608	3	1.002					

- 1、标准日期以添加项目时填入的“项目成立日期”开始，显示今天
- 2、显示净值时，若当日没有净值，则整行为空
- 3、插入特定日期的净值时，讲覆盖当天的旧净值

MOM管理系统

齐鲁证券资管
QILU ASSET MANAGEMENT

首页

MOM产品分析

MOM资产分布与
暴露

MOM绩效分析

MOM项目管理

估值表上传

说明：估值表命名请按照格式 日期格式（yyyymmdd）-备案号-名称

浏览

上传