



中信建投期货  
CHINA FUTURES



# 花 开有声 全新演绎

——私募基金尊享 成长计划 ▶



# 目录 / CONTENTS

---



人间四月 · 相约中信建投



芳菲伊始 · 走近私募备案



花季未了 · 开启阳光之旅



手有余香 · 感恩合作伙伴

【  中信建投期货 | 阳光私募业务 】

## 绽放·在阳光灿烂的日子

艰难的发行销售、高昂的通道成本、缺乏公信的业绩，中国私募基金的阳光化道路在曲折中前行了近二十年。这一切，在2014年这个芳菲的三月，划上了句号。私募备案制的正式实施，让私募基金真正感受到了阳光的温度。我们仿佛看到了私募基金从萌芽、成长到如今盛放的希望。

二十年期货行业的风雨历程，四年特殊法人业务的上下求索，让我们对私募基金的成长心路感同身受。

从有限合伙制的注册和税收服务，到私募基金的登记与产品备案；

从通道资源的对接服务，到私募基金的托管与估值；

从销售渠道的推介服务，到私募基金产品的正式代销；

我们的服务内容在不断创变，不变的是我们一直以来的承诺，“让机构客户专注于资产管理”，秉承对这种理念的坚持，我们收获的是合作伙伴的认可：

第一家基金专户参与股指期货的期货经纪商；

第一家私募基金参与股指期货的期货经纪商；

第一家新发行信托产品参与股指期货的期货经纪商；

乍暖还寒之际，我们闻到了私募业的第一缕花香。当服务被赋予创新的基因，是挑战亦是变革；我们致力改变，期待您的全新体验；我们真诚服务，期待您的全情绽放！

# 人间四月·相约中信建投

## 中信建投期货

诚信 专注 成长 共赢

荏苒二十年，弹指一挥间。二十年风雨同舟，二十年并肩携手，二十年用心经营，二十年承载梦想。

自 1993 年成立以来，中信建投期货一直秉承“服务创造价值，诚信赢得客户”的理念，坚持从客户需求出发，以客户需求解决为目标，凭借高度的敬业精神、突出的专业能力和热忱的服务，为广大投资者提供专业、高效的期货经纪服务。

作为中信建投证券股份有限公司的全资子公司，中信建投期货既专注传统经纪业务的高速发展，同时也顺应期货市场的变化和期货投资者机构化的发展趋势，在期货特殊法人业务、证券投资基金销售业务、资产管理业务等领域形成了自身特色和核心优势，搭建了研究咨询、信息技术、运营管理、风险控制、合规管理等高效的业务支持体系。

十年磨一剑，二十年来，中信建投期货伴随着中国期货市场发展的浪潮，从单一的经纪业务发展为具备期货经纪业务、期货投资咨询业务、资产管理业务及基金代销业务的全牌照期货公司，拥有上海期货交易所、大连商品交易所和郑州商品交易所会员资格，是中国金融期货交易所的交易结算会员；从单一总公司逐步发展为拥有北京、上海（两家）、济南、长沙、大连、南昌、郑州、廊坊、广州、漳州、重庆、合肥、成都、西安、深圳、杭州、宁波（筹）等十七家营业网点的全国性期货公司，还完美依托中信建投证券遍布全国 22 个省、80 多个城市的 150 家营业网点将我们优质的期货服务提供给全国各地的广大投资者。

放眼未来，中国期货行业正在质变中起航，行业创新层出不穷，市场结构体系日趋丰富，各类金融机构融合渗透加剧。在变革的时代里，期货公司与客户的共生关系更为密切，公司始终坚信客户赢，则公司兴。我们步步相随，陪伴客户每一步或风光或艰辛的成长；我们致力整合，打造资源丰富的平台；我们创新不止，与客户共赢未来。

我们不相信奇迹，我们只相信，用心服务，方能尽善尽美！

期货牌照		
		商品期货经纪业务
		金融期货经纪业务
		期货投资咨询业务
		资产管理业务
		证券投资基金销售业务
我们的荣誉		
	2010 - 2013 年	中金所优秀会员金奖
	2011 - 2013 年	中金所适当性制度落实奖
	2011 - 2013 年	“金融期货与期权研究”征文大赛优秀奖
	2013 年	客户管理奖
	2012 年	首批中金所国债期货仿真交易试点机构
		首批中金所股指期货仿真交易试点机构
2010 年	国内首个基金产品参与股指期货交易编码	
大连商品期货交易所	2013 年	年度优秀会员“最具成长性会员奖”
	2012 - 2013 年	中国财经风云榜投资者最满意期货公司
		期货程序化交易突出贡献奖
	2011 - 2013 年	年度品牌期货公司
	2013 年	客户最信赖期货公司
十佳理财团队		
	2007 - 2013 年	重庆金融贡献奖
	2013 年	重庆金融业第六届金鼎奖

# 芳菲伊始 · 走近私募备案

## 私募基金登记备案的性质是什么？

私募投资基金管理人登记和私募基金备案不属于行政许可事项。根据有关规定，由基金业协会负责私募投资基金管理人登记和私募基金备案，并履行行业自律监管职能。私募基金自律管理以信息披露为核心，以诚实守信为基础。私募基金管理人承诺对所提供信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

## 私募基金登记备案的范围有哪些？

私募证券投资基金、私募股权投资基金、创业投资基金等管理人应当向基金业协会履行私募投资基金管理人登记手续，所管理的私募基金应当履行基金备案手续。

## 私募基金管理机构是否必须履行登记手续？

根据《证券投资基金法》和有关规定，私募基金管理机构应当履行登记手续。否则，不得从事私募投资基金管理业务活动。基金业协会与中国证监会已建立私募基金登记备案信息共享和定期报告机制。已设立的私募基金管理机构应当在4月30日以前履行申请登记手续。对于已登记的私募基金管理人，基金业协会将提供各项服务；对于未登记的私募基金管理人，中国证监会将采取相应监管措施。

## 外资私募基金管理机构是否纳入登记备案范围？

境内注册设立的私募基金管理机构，应当向基金业协会履行私募基金管理人登记手续。境外注册设立的私募基金管理机构暂不纳入登记范围。

## 私募基金管理机构的人员资质如何取得？

对于私募基金管理机构的人员资质采取认定和新获取两种方式。认定的方式为通过公募基金的从业资格考试或从事金融工作三年以上，新获取方式为通过协会后期即将推出的从业资格考试。

### 对私募机构注册资金有无限制性要求？

目前对私募管理人的注册资金无限制要求，合伙制企业要求为实缴资本。

### 自然人是否能登记为私募基金管理人？

根据《证券投资基金法》规定，基金管理人由依法设立的公司或者合伙企业担任。自然人不能登记为私募基金管理人。

### 是否成为会员才可以发行私募产品？产品是否要求必须托管？

根据基金业协会规定，私募机构应当于4月30日前履行登记手续并注册成为基金业协会会员，在成为协会会员前私募可自行进行产品的发行，但产品正式运作之前私募必须在协会进行产品备案登记。

目前私募备案产品不强制要求托管，但鼓励进行托管。

### 私募基金如何进行信息披露？

由私募机构自行登录基金业协会系统进行信息披露，拟每月一次。私募基金管理人须承诺对所提供信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

### 非公开募集基金能否进行业绩公示？

非公开募集基金只能针对特定客户进行宣传和销售，因此其业绩不能公开对外进行公示，仅能对特定客户进行公示。

### 私募的公司以及购买私募基金产品的客户如何缴税？

备案的基金属于金融产品，按照现行金融产品规定执行，即免税；但有限合伙制、公司制按照《有限合伙法》和《公司法》的相关要求缴纳营业税、企业所得税和个人所得税。

### 私募备案产品是否可以直接开立期货、证券账户？

中国期货保证金监控中心已经增加了私募基金管理机构作为特殊单位客户申请开立交易编码的相关内容，在基金业协会登记的私募基金管理人，可为其管理的私募基金产品在期货市场开立账户。证券账户的开立中登公司将于近期发布相关开户指南。

# 花季未了 · 开启阳光之旅

## 概述

在中国基金业协会启动私募基金登记备案的政策背景下，我司推出私募基金运作综合化金融解决方案，为私募基金管理人提供包括产品创设、基金托管、净值计算、业绩发布、交易、清算在内的一站式服务。服务范围覆盖私募基金产品的全生命周期，从产品设计阶段到销售募集阶段，再到投资运作阶段，直至产品清算，打造全方位的私募基金综合运作平台，践行我司“让私募基金专注于资产管理”的机构客户服务理念。

## ◆ 服务对象

期货私募基金

期货职业投资者

证券类私募基金

## ◆ 服务项目

注册服务

产品销售服务

入会服务

产品备案登记服务

管理人备案登记服务

产品经纪服务

产品设计服务

产品运作服务

## ◆ 服务流程图



## ◆ 服务内容

### ■ 成长支持

基金协会入会服务

产品备案服务

公司注册

市场营销策划

孵化服务（组织机构、流程设计、人员培训）

顾问服务（财务顾问、税务顾问、法律顾问、合规顾问）

### 公司注册及相关服务

代办工商注册、变更服务：

代办工商注册服务包括核名、验资、刻章、  
办理执照、代码证、税务登记证、开户、  
网上报税软件等；

代办工商变更服务主要包括：有限合伙制  
基金每个月申赎涉及到入伙、退伙、变更  
出资和转让等变更。

有限合伙私募基金税收优惠地区：

上海市虹口区对冲基金园区

天津市东丽区、滨海高新区

苏州工业园区

深圳

新疆

## 基金业协会登记服务

### 相关政策规定

《证券投资基金法》（2013年6月1日起执行）

《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》（2014年2月7日起试行）

《私募基金登记备案系统操作手册》（2014年1月发布）

《私募基金登记备案系统填表说明》（2014年1月发布）

### 申请流程



## 运作支持

### 证券综合托管服务

母公司中信建投证券具备私募基金托管业务资格，可以为私募基金产品提供资产保管、资产净值计算和会计核算、资金划拨、监督私募基金管理人投资运作以及基金信息披露事项复核等服务。

资产保管

账户管理

募集资金验证

资金划拨

委托资产参与与退出

投资清算与交收

估值核算与业务监督

### 第三方托管估值服务

根据私募基金的产品运作需求，为在第三方机构进行托管的私募基金产品，对产品中的各类资产价值进行计算、评估，以确定产品份额的净值。

为私募基金产品进行独立清算和估值，保证估值过程中的中立性、客观性和公正性。公司拥有完善的估值系统以及估值经验丰富的服务人员，为产品提供快速、准确、专业的估值服务。

估值工作由托管机构负责进行监督，估值结果与托管机构进行核对。

## 销售支持

### 直销渠道

#### 线上模式

便捷安全的网上交易平台

Callcenter

微博、微信等媒介的线上网络营销体系

#### 线下模式

全国各主要城市近 20 家营业网点

350 余名具备专业投资知识的员工

一对一专业的产品咨询

### 代销渠道

银行渠道资源：同全国各主要银行均为合作伙伴关系。

证券渠道资源：依托母公司中信建投证券全国 130 多家营业网点，产品销售实力雄厚。

第三方理财机构渠道资源：与全国主要第三方理财机构保持着良好合作关系。

## IT 支持

公司随着期货市场的发展不断的进行技术创新和信息系统建设工作，为投资者提供更安全、高效、个性化的 IT 服务。目前公司已达到中国期货业协会制定的《期货公司信息技术管理指引》三类标准。

### 交易系统

#### 交易主席

公司主交易系统为上期 CTP 系统，其具有高可靠、高性能、大容量和接口开放等优势：

率先使用内存数据库技术、多活多交易中心技术等使得交易系统在速度和稳定性方面具有较大优势。

开放的交易平台，除了交易接口彻底开放之外，还开放结算接口和风控接口，已成为期货行业使用广泛的程序化交易接口。

为投资者提供了多种多样的个性化软件，其中“快期”交易终端深受好评，用它产生的交易量一度超过期货市场交易量的 30% 以上。

#### 其他程序化交易平台

公司在程序化、量化交易等方面积极探索，投入了大量资金和人力，完成平台建设、和技术储备，为客户提供，TB、文华、达钱 - MC，金字塔、大智慧 DTS 等程序化交易平台。

#### 其他交易系统

公司易盛交易系统和飞创交易平台 X-Speed 提供给主要交易郑交所和大商所的客户，其最大程度的保证了报单速度，方便专业投资者对接使用。

### 交易通道

公司在交易所所在地上海、大连建设有托管机房，为客户提供高速交易系统，满足客户特定交易所品种苛刻的交易速度要求。针对机构客户的特殊要求，公司建有 VIP 接入通道，并提供强有力的技术支持，协助机构客户构建快捷、可靠，稳定的交易通道。

上海张江机房不仅是交易系统的实时互备，同时为高端客户、机构投资者、程序化交易者等提供一整套解决方案。提供快速交易通道、行情数据中心、量化研究平台、多样化交易工具、程序化托管等全方位服务。

上海数讯机房提供 VIP 通道和程序化交易服务器托管。数讯 IDC 机房架构在 ChinaNET 和 CNC 骨干网上，拥有丰富的网络资源，是全方位、高稳定的电信级的互联数据中心。因其光纤直连中金所，对股指期货的报单响应速度将进一步的大幅提高。

### 机构服务

专线接入服务：我们为机构客户支持专线接入，客户可选择电信、联通等不同公司的线路商或上证通、深证通等方式与我司进行交易线路对接。

系统接入服务：公司为客户提供标准 API 接口，方便机构客户的各类交易终端直接接入我司交易系统。

服务器托管服务：客户可将其服务器托管于我司机房内，以便于进一步提高客户交易速度以及满足其风控的要求。

## 研发支持

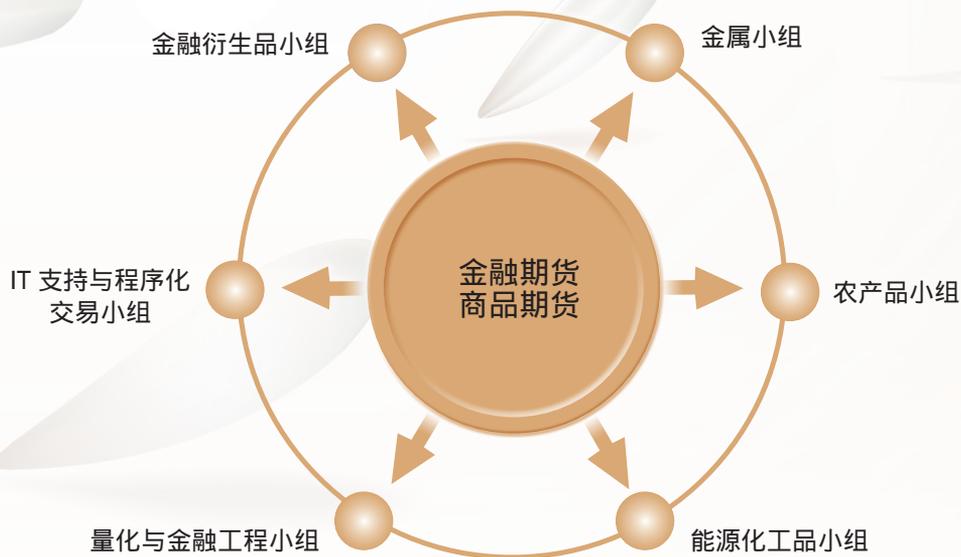
### 研发实力

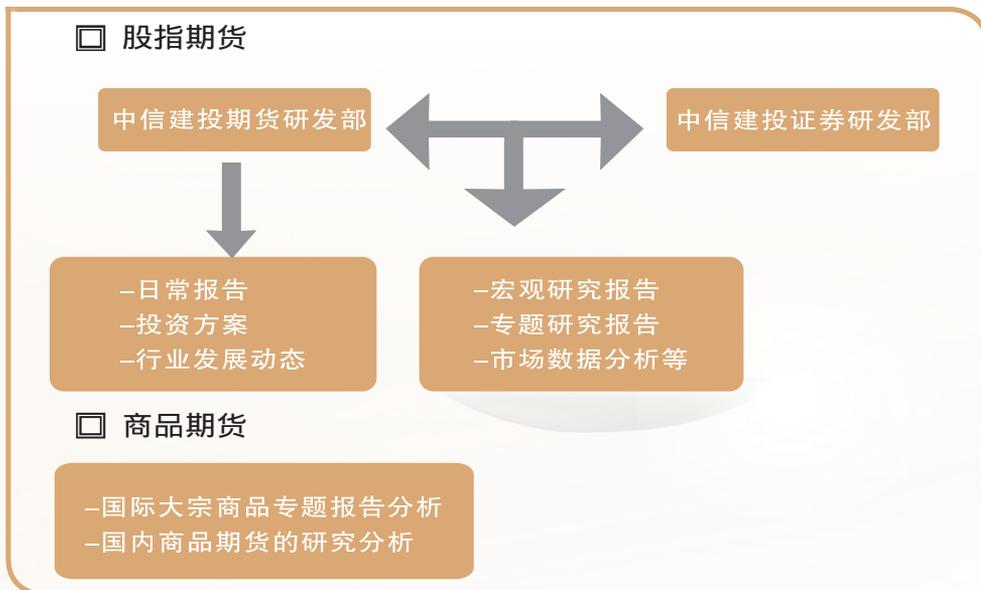
公司研究发展部坚持“引领专业投资，研究创造价值”的服务宗旨，为客户提供特色化的专业服务。在金融期货研究领域，研发报告不仅多次在国内相关评选机构获奖，而且还连续两届荣获中金所“金融期货与期权研究”征文大赛优秀奖。

商品期货方面，公司在有色金融研究领域颇具优势，曾获得上海期货交易所优秀金属分析师、杰出产业服务奖等。凭借与上海期货交易所的良好关系，多次为产业客户成功进行交割业务；农产品团队的企业服务之窗，以其特色的服务体系得到了广大产业客户的好评；煤焦钢团队深入产业链上下游，服务经验丰富，多次为大型钢铁企业、煤炭焦化企业设计风险管理方案。

### 研究体系

公司研发团队依托中信建投证券研究发展部强大的宏观经济研发实力  
研究领域覆盖宏观经济、量化交易、程序化交易、金融工程和投资策略等  
超越公募基金的待遇  
豪华五星级的服务





## ■ 风控支持

针对私募基金的不同风险控制需求，我们采用系统与人工相结合的方式，为各类私募基金产品量身打造定制化的风险管理方案，提供事前、事中及事后的交易风险管理。

### 产品风控建议

在产品设计中，与管理人进行充分沟通，根据产品策略与投资对象特性，提出专业风控建议，并根据管理人的风险控制要求，结合期货公司的风险控制手段与管理人确定产品运作风控方案。

### 系统风险控制

我们一直坚持以信息技术手段支持风险控制需求，及时跟踪政策法规变化，积累产品风控要求，对系统进行持续升级。我们将运用系统对管理人的风控方案进行风险指标设置，根据管理人要求进行交易事前风控或交易过程中提示风控。

### 交易风险提示

我们提供对管理人的交易风险提示，管理人可设置不同级别的风险警示，当产品达到风险预警时，公司采取与管理人约定的提示方式，根据不同警示水平以邮件、电话或其它方式通知管理人，协助管理人实现风险管理的要求。

## 手有余香·感恩合作伙伴

(排名不分先后)

基金公司	 国投瑞银 UBS SDIC	 汇添富基金 China Universal Asset Management	 博时基金 BOSERA FUNDS
	 建信基金管理公司 CCB Principal Asset Management Co., Ltd.	 鹏华基金 PENGHUA PENGHUA FUND	 富国基金管理有限公司 Fullgoal Fund Management Co., Ltd.
	 华宝兴业基金管理有限公司 Fortune SG Fund Management Co., Ltd.	 华夏基金 China AMC	 招商基金 CHINA MERCHANTS FUND
	 长安基金 CHANGAN FUNDS	 中信建投基金管理有限公司 China Fund Management Co., Ltd.	
信托公司	 华宝信托 HWABAO TRUST	 华润信托 让资产更智慧	 中融信托
	 FOTIC 中国对外经济贸易 信托有限公司	 中信信托 CITIC TRUST	
私 募	 上海申毅投资咨询有限公司 sem	 浙商控股 浙商控股集团 ZHESHANG HOLDINGS 上海资产管理有限公司	 昆盟资产 CONVERGE CAPITAL
	 盈峰资本 INFENG CAPITAL	 深圳民森投资有限公司 SHENZHEN MINSHEN INVESTMENT CO., LTD.	
	 LIGHORSE	 长余资本 Changyu Capital	江苏长余资本管理有限公司
	 深圳市翼虎投资管理有限公司 Flying Tiger WWW.FLYINGTIGERFUNDS.COM	 安苏 ANNSU	敦和投资
银 行	 中国工商银行 INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	 中国銀行 BANK OF CHINA	 中国农业银行 AGRICULTURAL BANK OF CHINA
	 交通銀行 BANK OF COMMUNICATIONS	 中信銀行 CHINA CITIC BANK	 浦发銀行 SPD BANK

## 总 部

### 中信建投期货有限公司

重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼 邮编：400014

全国客服电话：4008877780

### 机构服务电话

重庆：023-86769637 023-86769742 023-88060499

上海：021-68762408 021-58302346

深圳：0755-33378750 0755-33378792

广州：020-28325286

北京：010-85282866

## 营业网点

营业部	地 址	联系电话
北京营业部	北京市东城区朝阳门北大街 6 号首创大厦 207 室	010-85282866
上海世纪大道	上海浦东世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 8 楼 08-11 单元	021-68763048
济南营业部	济南市泺源大街 150 号中信广场 606 室	0531-85180636
长沙营业部	长沙市五一大道 800 号中隆国际大厦 903	0731-82681581
大连营业部	大连市沙河口区会展路 129 号国际金融中心 A 座期货大厦 2904	0411-84806305
南昌营业部	南昌市八一大道 96 号华龙国际大厦 1303-1305 室	0791-6700300
郑州营业部	郑州市金水区未来大道 69 号未来大厦 2205、2211 室	0371-65612397
廊坊营业部	河北省廊坊市广阳区广阳道 20 号中太大厦 7 层	0316-2326908
广州营业部	广州市越秀区东风中路 410-412 号时代地产中心 605	020-28325286
漳州营业部	漳州市芗城区南昌路华联商厦 7 楼	0596-6161566
重庆营业部	重庆市渝北区冉家坝龙山一路扬子江商务中心 10-2	023-88502020
合肥营业部	合肥市马鞍山路 130 号万达广场 6 号楼 1903-1905	0551-2876855
成都营业部	成都市武侯区科华北路 62 号力宝大厦南楼 1802 室	028-62818770
西安营业部	西安市高新区科技路 38 号林凯国际大厦 1604、05 室	029-68500986
深圳营业部	深圳市福田区车公庙 NEO 大厦 11 栋 1 单元	0755-33378795
上海曹溪北路	上海徐家汇曹溪北路 321 号中金国际广场 A 座 9 层 B 室内	021-33973869
杭州营业部	杭州市上城区庆春路 137 号华都大厦 811、812 室	0571-87079379
宁波营业部(筹)	宁波市江东区朝晖路 17 号	



中信建投期货  
CHINA FUTURES

地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼  
邮编：400014  
电话：023-86769605  
全国统一客服热线：400-8877-780

[www.cfc108.com](http://www.cfc108.com)