

瑞达期货-完胜 1 号资产管理计划 2017 年第 4 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	瑞达期货-完胜 1 号资产管理计划
基金编码	SX3403
基金管理人	瑞达期货股份有限公司
基金托管人（如有）	招商证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2017 年 10 月 25 日
报告期末基金份额总额	55,394,802.11
投资目标	以积极的投资组合管理为手段，追求较高收益
投资策略	<p>主要运用主动管理交易、主力跟踪策略，利用期货品种价格存在的趋势机会，期货品种之间的定价偏差获取收益。主要为归纳以下几类策略：1、明胜战法策略：“明胜战法”融合了拥有 20 多年分析交易的实盘操作经验和智慧的精华，利用在 K 线图上主力动向的表现与量价、指标的有机结合，当多空线明显出信号的时候积极跟多或者跟空。洞悉主力多空操作意向，顺势而为，博取交易收益。2、趋势追踪策略 通过高胜率趋势追踪模型，提供交易进场及出场机会判断，同时根据盘面持仓和成交量变化，主做行情的突破，根据均线变化动态追踪，有效规避假突破，而把握住行情的启动赚取波段收益。3、日内短线策略 该类策略不依赖于品种价格趋势变化，只追求日内小周期的价格波动，不持仓隔夜。</p>
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本计划为 R3（中）等级产品，适合风险识别、评估、承受能力为 C3（稳健）、C4（积极）、C5（激进）的合格投资者。
报告是否经托管机构复核	是

2、基金净值表现

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)
当季	-4.39	-	-	-
自基金合同生效起至今	-4.39	-	-	-

说明：净值增长率等于（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率等于（本季度末累计净值-上季度末累计净值）/上季度末累计净值

3、主要财务指标

单位：人民币元

项目	2017年10月25日至2017年12月31日
本期已实现收益	-1,965,743.71
本期利润	-2,435,890.56
期末基金资产净值	52,964,109.44
期末基金份额净值	0.9561

4、投资组合报告

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	44,587,183.37	83.86
8	其他各项资产	8,582,777.10	16.14
	合计	53,169,960.47	100.00

注：其他各项资产：主要包括三方存管保证金、其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含港股通)

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	0.00	0.00

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00

4.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
港股通	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	52,200,000.00
报告期期间基金总申购份额	3,194,802.11
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	55,394,802.11

6、管理人报告

在风险可控前提下，在策略使用上，2017年四季度延续“多策略、多周期，低风险、小回测”思路，尽量抓住品种策略机会，提升客户收益。

从市场表现来看，四季度商品指数期货价格在振荡中缓慢抬高。其中，工业品板块趋势性较之前有所减弱，但基本上仍保持在高位偏强运行，农产品板块出现分化，油脂出现波段下跌后，于年末企稳，玉米、淀粉则演绎阶段性走高行情。从策略结果来看，商品期货采取以“波段交易+短期对冲”交易相结合的模式，提升收益同时降低短期波动风险。宏观上，我国前三季度经济数据总体向好，质量有所提升。此外，全

球经济保持扩张、年报业绩以及资金面供需改善等因素所带来的增量资金，都有望为
期指春季波动提供动能，策略上维持以价值投资为主导，并适时猎取三大股指期货之
间品种套利以及跨期套利机会。

从结果来看，四季度整个产品系列净值维稳，主要策略经过调整和再优化后，预计未
来整体表现会更好。

托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的规定，对本基金在本报告
中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。