

# 瑞达期货-瑞达资管 15 号资产管理计划 2017 年第 3 季度报告

## 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	瑞达期货-瑞达资管 15 号资产管理计划
基金编码	SS1415
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 08 月 28 日
报告期末基金份额总额	7,218,848.70
投资目标	在风险适度可控前提下，追求稳定、长期的适度收益。
投资策略	<p>主要运用主动管理交易、对冲交易策略，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、组合策略 在单一品种上采取多种类型的策略组合，可从不同角度充分挖掘价格变化规律，在不同阶段性行情特征下均可捕捉交易机会；采取不同时间周期上的策略组合，中长线与短线交易、隔夜与日内交易相配合，可在长期趋势行情中寻找短线震荡造成的反向交易机会，以达到长短结合、优势互补的效果，降低产品收益的回撤。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，投资经理进行策略制定并下达交易指令。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	-1.84	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.84	-	-	-

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08月28日至2017年09月30日
本期已实现收益	-111,869.89
本期利润	-114,014.89
期末基金资产净值	7,085,985.11
期末基金份额净值	0.9816

### 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	6,197,675.35	87.32
8	其他各项资产	900,302.57	12.68
	合计	7,097,977.92	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	6,200,000.00
报告期期间基金总申购份额	1,018,848.70
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	7,218,848.70

#### 6、管理人报告

在风险可控的前提下，第三季度团队顺应市场行情变化，适当调整投资品种结构比例，产品净值持续提升。在策略使用上，依旧坚持“多策略、多周期，低风险、小回测”思路。从市场表现来看，三季度商品期货演绎先扬后抑的行情，板块间波动幅度分化明显，工业品波动加剧，出现趋势性拐点，农产品波动区间相对窄小。商品策略与配置上，采取“波段趋势+短期对冲”相结合的交易模式，在尽量控制短期波动风险基础上，追求长期稳健收益。宏观上，尽管三季度经济数据平稳回落，但经济的“韧性”仍有望超出市场预期，央行定向降准及重大会议过后，市场风险偏好得到改善，支撑股指继续上行，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机会，以及股指期货远月合约贴水较大的跨期套利机会。

从结果来看，三季度整个产品系列净值延续二季度稳步上升态势，主要策略经过调整和再

优化后，预计未来整体表现会更好。