

瑞达期货-瑞达资管 15 号资产管理计划 2018 年第 1 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 | 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。 |
| 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 | -5.38 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -4.75 | - | - | - |

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 | 2018年01月01日至2018年03月31日 |
|----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | -241,479.45 |
| 本期利润 | -391,610.70 |
| 期末基金资产净值 | 6,875,673.90 |
| 期末基金份额净值 | 0.9525 |

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 | 5,462,542.68 | 79.00 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,452,416.10 | 21.00 |
| | 合计 | 6,914,958.78 | 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 | 7,218,848.70 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 0.00 |
| 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

2018年第一季度仍坚持在风险可控前提下，尽量提高产品的净值，在策略上仍维持“多策略、多周期，低风险、小回测”思路。

从市场表现来看，一季度商品指数价格在经过一段时间的区间振荡后，选择向下突破，形成一波下跌行情。其中，因中美贸易争端升级，农产品和工业品板块走势分化加剧，以豆粕为代表的农产品板块波动幅度明显增大。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。宏观上，2018年一季度经济数据延续稳中有进、稳中向好的发展态势，主要受房地产投资增速逆势扩张和外需强劲带动。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，一季度整个产品系列有所回撤，主要策略经过调整和再优化后，预计二季度表现会更好。

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。