

# 瑞达期货-瑞智共赢 2 号资产管理计划 2016 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-瑞智共赢 2 号资产管理计划
基金编号	SD1081
基金管理人	瑞达期货股份有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015 年 12 月 07 日
报告期末基金份额总额	58,126,624.39 份
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	本产品致力于通过覆盖多市场的多元化投资品种以及投资策略的多样性和灵活性，根据市场运行状态，采用多品种、多周期、多策略管理客户资产，通过调整投资品种结构比例，设置合理的风险控制级别，通过人工为主、结合系统信号的方式积极主动参与市场交易，实现以较少的投资风险来获取较多投资收益。
业绩比较基准	-
风险收益特征	风险适中，收益较高

## 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	-3.26%	-	-	-
自基金合同生效起至今	-5.18%	-	-	-

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	2016-01-01 至 2016-03-31
本期已实现收益	-2,460,852.83
本期利润	-1,677,670.36
期末基金资产净值	55,117,957.50
期末基金份额净值	0.9482

## 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,034,831.72	77.68
8	其他各项资产	12,364,460.40	22.32
	合计	55,399,292.12	100.00

### 4.2 期末按行业分类的股票投资组合

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

S	综合	-	-
	合计	-	-

## 5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	52,839,420.77
报告期期间基金总申购份额	5,287,203.62
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	58,126,624.39

## 6、管理人报告

因宏观基本面并未出现根本性的改变，2016年年初基本上延续去年第四季度策略，股指继续持有多单，以超跌反弹为主；商品仍以做空为主。但受汇率贬值和股指熔断机制推出等影响，元旦开盘后，股指再次出现重挫。股指原本流动性就不足，而熔断机制推出无疑是雪上加霜，在造成市场恐慌同时，无法有效地在短时间内对冲持仓风险。基于市场非理性的抛售、整个宏观基本面环境和股指持仓占比较低等综合考虑，并未对股指持仓进行重大调整。大宗商品在1、2月份开始大幅波动，呈现探底反弹趋势，经过研究，我们逐步对持仓方向进行调整。受商品趋势得改变和股指非理性下挫，导致一季度整个产品净值出现一定的回撤。