

# 瑞达期货-瑞智无忧共赢 1 号资产管理计划 2018 年第 2 季度报 告

## 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	瑞达期货-瑞智无忧共赢 1 号资产管理计划
基金类型	商品及金融衍生品
基金编码	S24201
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	2015 年 03 月 16 日
报告期末基金份额总额	5,599,838.84
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（如有）	-
风险收益特征	产品风险等级 R3，适合 C3/C4/C5 级投资者
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	-0.31	-	-	-
自基金合同生效起至今	59.10	-	-	-

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 04 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日
本期已实现收益	-188,749.24

本期利润	-97,949.52
期末基金资产净值	5,739,559.88
期末基金份额净值	1.0250

#### 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	2,575,119.76	44.61
8	其他各项资产	3,197,855.30	55.39
	合计	5,772,975.06	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	7,685,344.58
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	2,085,505.74
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	5,599,838.84

#### 6、管理人报告

2018年第二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。在“宽货币、紧信用、严监管”背景下，受中美贸易争端事件和海外资本市场影响，二季度股指与商品走势波动较大，产品净值出现一定的回撤。为了尽量减少波动与部分品种单边风险，当前仍采取“全品种、多周期”交易策略为主，除不活跃品种外，本产品涉及到交易品种大概30多个。根据策略量化信号，目前商品类策略以对冲为主，单边敞口多以空头为主；而配置股指类策略以多头为主。二季度，商品类策略表现尚可，对净值影响不大，其中，橡胶、螺纹等对产品净值贡献较大，其中，股指（沪深300）成为拖累产品主因。

展望第三季度，A股资本市场经过前期大幅下挫，股指的估值优势渐显，有利于价值投资的配置。中美贸易事件影响将进一步淡化，事件对策略干扰进一步减弱，无特别事件外，预计三季度及下半年产品预期表现好于上半年。同时，我司资管部也在积极改进策略，并加快新策略的开发，以提升产品的表现。

该产品本季度变更投资范围，由原条款“（二）投资范围：本产品投资于中国金融期货交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所上市的期货产品合约，包括但不限于期货、期权及其他金融衍生品。”变更为“（二）投资范围：本产品主要投资于包括国内上海期货交易所、大连商品交易所和郑州商品交易所依法发行的商品期货和商品期权，中国金融期货交易所依法发行的股指期货、以及上海国际能源交易中心依法发行的原油期货。”

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。