

# 私募投资基金信息披露季度报表

## 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	瑞达期货-瑞智进取共赢1号资产管理计划
基金编号	S30047
基金管理人	瑞达期货股份有限公司
基金托管人(如有)	国信证券股份有限公司
投资顾问(如有)	
基金运作方式	开放式
基金合同生效日期	2015-04-21
报告期末基金份额总额	126,233,128.26
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	本产品主要以趋势追踪为主,日内短线,套利交易为辅助。投资品种注重多元化,以达到减少总体风险的目标。
业绩比较基准(如有)	
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	-1.1			
自基金合同生效起至今	30.5			

注: 净值增长率 = (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 = (本季度末累计净值 - 上季度末累计净值) / 上季度末净值

## 3、主要财务指标

单位: 元

项目	2016-01-01 至 2016-03-31
本期已实现收益	-3,617,285.95

本期利润	-1,892,950.94
期末基金资产净值	122,935,255.3
期末基金份额净值	0.974

#### 4、投资组合情况

##### 4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额 (人民币)	占基金总资产的 比例 (%)
1	权益投资	0	0
	其中：普通股	0	0
	存托凭证	0	0
2	基金投资	0	0
3	固定收益投资	0	0
	其中：债券	0	0
	资产支持证券	0	0
4	金融衍生品投资	123,558,295.47	97.87
	其中：远期	0	0
	期货	123,558,295.47	97.87
	期权	0	0
	权证	0	0
5	买入返售金融资产	0	0
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0	0
6	货币市场工具	0	0
7	银行存款和结算备付金合计	16,416.54	0.01
8	其他	2,624,352.42	2.12
	合计	123,574,712.01	100

##### 4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合(注：不包括港股通数据)

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	0
B	采矿业	0	0

C	制造业	0	0
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0	0
E	建筑业	0	0
F	批发和零售业	0	0
G	交通运输、仓储和邮政业	0	0
H	住宿和餐饮业	0	0
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0	0
J	金融业	0	0
K	房地产业	0	0
L	租赁和商务服务业	0	0
M	科学研究和技术服务业	0	0
N	水利、环境和公共设施管理业	0	0
O	居民服务、修理和其他服务业	0	0
P	教育	0	0
Q	卫生和社会工作	0	0
R	文化、体育和娱乐业	0	0
S	综合	0	0
	合计	0	0

#### 4.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-

注：以上分类采用中国证券监督管理委员会制定的《上市公司行业分类指引》

#### 5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	126,233,128.26
报告期期间基金总申购份额	0
减：报告期期间基金总赎回份额	0

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
报告期期末基金份额总额	126,233,128.26

**6、管理人报告**（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等）

--