

瑞达期货-冠优股指集合资产管理计划 2018 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-冠优股指集合资产管理计划
基金编码	SCP192
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	2018 年 05 月 31 日
报告期末基金份额总额	2,000,000.00
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>“本产品致力于股指期货权重增强型策略运作。利用股指期货多空皆宜的特性，灵活掌握长短期趋势，操作时可动态调整部位并顺势操作，使利润极大化，风险回撤极小化。同时配合多元商品及策略组合，透过策略组合互补，降低单一策略获利回调时的压力及投资风险，建构稳定绩效之投资组合，提高投资组合市场适应性。配合风险控管系统，严密管理投资与交易风险，并透过保护型投资策略，使产品取得回报报酬最大化。</p> <p>1. 股指趋势进取策略：以趋势交易为主，采用进取策略以技术分析为主要依据，捕捉市场短期热点，再结合部分风格稳健相对的技术信号，以股指期货的单边趋势交易为重点。</p> <p>2. 商品保护策略：以基本面宏观经济分析为基础，结合商品供求关系得出大周期的持仓方向和数量，实战中再配合日内短线强弱对冲策略，并针对策略 1 做保护策略。</p> <p>3. 股指套利交易策略：结合市场情绪分析，利用上证 50、中证 500 和沪深 300 指数之间的强弱相关性，做套利交易策略。”</p>
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本计划为 R4 等级产品，适合风险识别、评估、承受能力为 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	业绩比较基准收	业绩比较基准收
----	----------	---------	---------	---------

		差(%)	益率(%)	益率标准差(%)
当季	-2.33	-	-	-
自基金合同生效起至今	-2.36	-	-	-

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07月01日至2018年09月30日
本期已实现收益	-85,038.71
本期利润	-46,518.71
期末基金资产净值	1,952,876.32
期末基金份额净值	0.9764

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	1,773,390.74	90.52
8	其他各项资产	185,673.60	9.48
	合计	1,959,064.34	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	2,000,000.00
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	2,000,000.00

6、管理人报告

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。根据客户的需要、资金规模以及市场状况等，适当的配置及调整相关策略，以求实现策略受益最优化。

在“宽货币、紧信用、严监管”与中美贸易争端事件大背景下，三季度A股资本市场呈弱势震荡格局。但A股跌至前期低点附近，估值跌至近10年新低，估值优势明显。根据基

本面和估值优势，少量配置股指，净值小幅回升。
展望第四季度，从宏观背景、资本市场政策和估值优势，估值下跌空间有限。但受悲观情绪的压制，股指仍将探底过程，但目前向上空间（机会）更大。待市场情绪改观，股指有望重新回归至理性区间。在策略上少量配置股指，实施控制风险，待市场好转。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。

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。