

# 瑞达期货-瑞智无忧共赢66号集合资产管理计划

## 2024年2季度报告

产品管理人：瑞达期货股份有限公司

产品托管人：国泰君安证券股份有限公司

## 1、产品基本情况

| 项目            | 信息                       |
|---------------|--------------------------|
| 产品名称          | 瑞达期货-瑞智无忧共赢 66 号集合资产管理计划 |
| 产品编码          | SQG411                   |
| 产品管理人         | 瑞达期货股份有限公司               |
| 产品托管人（如有）     | 国泰君安证券股份有限公司             |
| 投资顾问（如有）      |                          |
| 产品运作方式        | 开放式                      |
| 产品成立日期        | 2021-05-17               |
| 报告期末产品份额总额（份） | 5,751,679.33             |

## 2、产品净值表现

| 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         | 0.04     | -           | -            | -               |
| 自产品合同生效起至今 | 0.32     | -           | -            | -               |

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）/上季度末累计净值

如为分级产品，应按级别分别列示。

表中指标均以不带百分号数值形式填写，请保留至小数点后2位。

## 3、主要财务指标

金额单位：元

| 项目       | 2024-04-01 | 至 | 2024-06-30 | (元)          |
|----------|------------|---|------------|--------------|
| 本期已实现收益  |            |   |            | 213,450.04   |
| 本期利润     |            |   |            | -114,582.74  |
| 期末产品净资产  |            |   |            | 5,769,806.94 |
| 期末产品单位净值 |            |   |            | 1.0032       |

注：如为分级产品，应按级别分别列示。

## 4、投资组合情况

### 4.1、期末产品资产组合情况

金额单位：元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占产品总资产 |
|----|----|----|--------|
|----|----|----|--------|

|   |                   | 人民币          | 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      | 4,515,624.65 | 77.55  |
| 8 | 其他                | 1,307,010.60 | 22.45  |
|   | 合计                | 5,822,635.25 | 100.00 |

注：

## 4.2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 4.2.1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

| 序号 | 行业类别             | 公允价值 | 占产品资产净值比例(%) |
|----|------------------|------|--------------|
| 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 |

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 4.2.2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：元

| 行业类别    | 公允价值（人民币） | 占产品资产净值比例(%) |
|---------|-----------|--------------|
| 基础材料    | 0.00      | 0.00         |
| 消费者非必需品 | 0.00      | 0.00         |
| 消费者常用品  | 0.00      | 0.00         |
| 能源      | 0.00      | 0.00         |
| 金融      | 0.00      | 0.00         |
| 医疗保健    | 0.00      | 0.00         |
| 工业      | 0.00      | 0.00         |
| 信息技术    | 0.00      | 0.00         |
| 电信服务    | 0.00      | 0.00         |
| 公用事业    | 0.00      | 0.00         |
| 房地产     | 0.00      | 0.00         |
| 合计      | 0.00      | 0.00         |

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。 本报表“其他”项中列示的主要包括期货交易保证金、各类应收款等，具体情况见《其他资产构成报表》。

## 5、产品份额变动情况

单位：份

|              |               |
|--------------|---------------|
| 报告期期初产品份额总额  | 12,152,285.33 |
| 报告期期间产品总申购份额 | 0.00          |

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 减：报告期期间产品总赎回份额            | 6,400,606.00 |
| 报告期期间产品拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00         |
| 报告期期末产品份额总额               | 5,751,679.33 |

注：

如为分级产品，应按级别分别列示。

如产品成立日晚于报告期期初，则以产品成立日的产品份额总额作为报告期期初产品份额总额。

## 6、管理人报告

### 6.1 基金经理简介

本产品投资经理为张夕阳。

张夕阳，博士研究生，2010年加盟瑞达期货，先后从事商品及金融衍生品研究，负责资管管理产品策略开发、投资、结构化产品设计等。具有多年的从业经验和丰富的专业金融投资经历与产品管理经验，累计管理资金CTA总规模60亿以上。

### 6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 6.3 公平交易专项说明

#### 6.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合（策略）享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象（策略）备选库，制定明确的（策略）备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

在交易执行方面，本管理人实行了集中交易制度和公平的交易分配制度。投资策略是通过资管示范账户进行程序化自动交易，并向交易员提示交易合约及交易方向，交易员根据示范账户的交易提示，通过策略子账户进行批量交易，即采用相同策略的不同资管产品，交易员下单交易指令后，金牛资管系统依据事先设定的交易参数，自动分配到不同资管产品的期货账户进行交易。资管示范账户进行定期轮换。

#### 6.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《瑞达期货资产管理业务交易监控制度》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。重点监控是否存在以下情形：（一）通过自成交影响合约价格；（二）成交价格明显超出合理范围。

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

### 6.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品主要投资于以商品期货、金融期货等为代表的商品及金融衍生品相关资产。无特殊合同约定，本基金采取“多品种、多周期、多策略”组合模式，以相对均衡的配置分散投资风险，增加了

基金资产抵抗风险的能力；同时，采用资金管理优势提升资产收益，达到“风险分散、盈利集中”的效果。

今年以来美联储货币政策始终是大宗商品价格的主要影响因素，特别是贵金属和有色金属价格。但相较于年初，美债收益率的表现反应市场已基本消化了年内 1-2 次降息的预期，下半年美联储货币政策给市场带来的“惊喜”可能也会相应减少，但全球央行降息潮的开始，以及相对宽松的金融条件下，或将意味着新一轮商品周期的启动。相比于货币政策，“意外”可能更多会来自于年底的美国总统大选、欧洲政坛、地缘冲突的演变，可能对全球供应链、能源、农产品带来额外的波动。

国内供给端的修复始终要快于需求端的改善，而这也成为内外定价品种强弱分化的重要原因。需供给偏松的现象不仅在黑色、建材板块有所体现，同样也反应在农产品板块上。今年以来设备更新、特别国债、房地产 517 新政等改善需求不足的政策举措加速出台，不断给市场带来积极的预期，但产能利用率、库存、消费等指标并未随市场预期而显著改善，这也导致了商品价格在短期反弹后，重回下行通道。下半年驱动行情或将更多来自产业现实，但一些重大事件提供新的机会仍值得关注，如，“三中全会”，美国大选及大国博弈，俄乌、巴以冲突是否重大变动等。

报告期内，Wind 商品指数上涨 8.31%，沪深 300 指数下跌 2.14%。关于本基金的运作，CTA 仓位保证金占比维持在合理水平，因净值不同和根据市场波动情况，仓位存在差异。

#### 6.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率如上表 2。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

## 附：其他资产构成报表

金额单位：元

| 序号  | 名称         | 金额           |
|-----|------------|--------------|
| 1   | 交易保证金      | 1,307,010.60 |
| 1.1 | 其中：期货交易保证金 | 1,307,010.60 |
| 2   | 应收证券清算款    | 0.00         |
| 3   | 应收股利       | 0.00         |
| 4   | 应收基金红利     | 0.00         |
| 5   | 应收利息       | 0.00         |
| 6   | 应收申购款      | 0.00         |
| 7   | 其他应收款      | 0.00         |
| 8   | 待摊费用       | 0.00         |
| 9   | 其他         | 0.00         |
| 10  | 合计         | 1,307,010.60 |