

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	封闭式
基金合同生效日期	2015-4-21
报告期末基金份额总额	59,269,294.01
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	2.16			
自基金合同 生效起至今	32.26			

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	2016-04-01 至 2016-06-30 (元)
本期已实现收益	4,426,518.18
本期利润	2,562,902.12
期末基金资产净值	58,954,709.69

期末基金份额净值	0.995
----------	-------

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	0.00	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	22,799,777.40	38.32
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	22,799,777.40	38.32
	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	36,697,046.80	61.68
8	其他	0.00	0.00
	合计	59,496,824.20	100.00

4.2 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	0.00	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

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	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	66,963,834.25
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	59,269,294.01

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）

为了规避宏观系统性风险，二季度总策略仍围绕“多市场、多品种、多周转、多策略，辅助严格的风控”来展开。具体品种配置策略来看，因经济企稳和宏观数据利好，金融股指市场逐步回暖，但因受市场流量的限制和日内开仓局限，低配股指期货。在商品期货上，大类商品期货品种以对冲为主，前期的主策略以“强多空弱”为主，二季度后期策略又较大改变。具体来说，在黑色系商品期货品种上，前期以做多螺纹为主，4月份以后逐步改变策略；受原油市场回升，配置一些与原油有关的化工产品；同时，前期以做空农产品以对冲工业品。因二季度商品期货市场波动，期间对各策略进行多次调整。从结果来看，整体上较好地把握市场行情走向，各资管产品净值得以回升。但因市场流量有限且波动较大，导致资产净值出现一定的波动。此外，因前期资产净值回撤超预期，二季度整个产品的仓位配置较低，限制了产品整体收益水平。