

## 瑞达期货-完胜 1 号资产管理计划 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-完胜 1 号资产管理计划   |
| 基金编码        | SX3403  |
| 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      | 2017 年 10 月 25 日  |
| 报告期末基金份额总额  | 13,013,234.56   |
| 投资目标        | 以积极的投资组合管理为手段，追求较高收益  |
| 投资策略        | <p>主要运用主动管理交易、主力跟踪策略，利用期货品种价格存在的趋势机会，期货品种之间的定价偏差获取收益。主要为归纳以下几类策略：</p> <p>1、明胜战法策略：<br/>“明胜战法”融合了拥有 20 多年分析交易的实盘操作经验和智慧的精华，利用在 K 线图上主力动向的表现与量价、指标的有机结合，当多空线明显出信号的时候积极跟多或者跟空。洞悉主力多空操作意向，顺势而为，博取交易收益。</p> <p>2、趋势追踪策略<br/>通过高胜率趋势追踪模型，提供交易进场及出场机会判断，同时根据盘面持仓和成交量变化，主做行情的突破，根据均线变化动态追踪，有效规避假突破，而把握住行情的启动赚取波段收益。</p> <p>3、日内短线策略<br/>该类策略不依赖于品种价格趋势变化，只追求日内小周期的价格波动，不持仓隔夜。</p> |
| 业绩比较基准（如有）  | -   |
| 风险收益特征      | 本计划为 R3（中）等级产品，适合风险识别、评估、承受能力为 C3（稳健）、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(%) | 净值增长率标准差(%) | 业绩比较基准收益率(%) | 业绩比较基准收益率标准差(%) |
|----|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当季 | 12.50    | -           | -            | -               |

|                |       |   |   |   |
|----------------|-------|---|---|---|
| 自基金合同<br>生效起至今 | -0.63 | - | - | - |
|----------------|-------|---|---|---|

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  | 945,330.35              |
| 本期利润     | 1,454,314.14            |
| 期末基金资产净值 | 12,931,611.82           |
| 期末基金份额净值 | 0.9937                  |

### 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      | 10,300,827.66 | 79.24        |
| 8  | 其他各项资产            | 2,698,353.50  | 20.76        |
|    | 合计                | 12,999,181.16 | 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               | 14,513,234.56 |
| 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            | 1,500,000.00  |
| 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               | 13,013,234.56 |

#### 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”大背景下，受中美贸易争端事件后续影响，三季度股指与商品波动较大。为了尽量减少波动与部分品种单边风险，当前主要采取“全品种、多周期”交易策略为主，除不活跃品种外，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，重点关注热点品种，如热卷、焦炭、橡胶、豆粕等。

从表现来看，三季度商品类策略表现尚可，产品净值小幅上升。  
展望第四季度，11 月份美国中期选举等将进一步“干扰”商品市场，伴随事件起伏，商品波动或将加大，投资机会将再现。与此同时，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。