

金信纯达正合 CTA 进取 1 号集合资产管理计划 2022 年第 3 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	金信纯达正合 CTA 进取 1 号集合资产管理计划
基金编码	STC606
基金管理人	金信期货有限公司
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	2021 年 12 月 08 日
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	1,087.038249
投资目标	在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
投资策略	本计划使用量化 CTA 策略，通过对金融市场数据的统计演绎，构建数学模型，寻找一定概率下存在的特定交易模式，通过较高频率的交易，最终获得超额收益，策略的主要类型有趋势追踪策略、均值回归策略、套利策略、基本面量化策略等。
业绩比较基准（如有）	不设置业绩比较基准
风险收益特征	本计划属于 R4 级（中高风险）投资品种。
信息披露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	3.75	-	-	-
自基金合同生效起至今	9.32	-	-	-

注：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

金额单位：元

项目	2022-07-01 至 2022-09-30
本期已实现收益	392,700.03
本期利润	429,070.39
期末基金净资产	11,883,108.01

报告期期末单位净值	1.0932
-----------	--------

4、投资组合报告

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	93,211.16
境内未上市、未挂牌公司股票投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	0.00
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	10,485,880.12
境内证券投资规模	存出保证金	1,360,224.00
	股票投资	0.00
	债券投资	0.00
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	0.00
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	0.00
	期货及衍生品交易保证金	1,360,224.00
	买入返售金融资产	0.00
	其他证券类标的	0.00
资管计划投资	商业银行理财产品投资	0.00
	信托计划投资	0.00
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	保险资产管理计划投资	0.00
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	私募基金产品投资	0.00
	未在协会备案的合伙企业份额	0.00
另类投资	另类投资	0.00
境内债权类投资	银行委托贷款规模	0.00
	信托贷款	0.00
	应收账款投资	0.00
	各类受（收）益权投资	0.00
	票据（承兑汇票等）投资	0.00
	其他债权投资	0.00
境外投资	境外投资	0.00
其他资产	其他资产	0.00
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00

证券
资产
核算

	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	0.00

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

股份
托管
清算
2403

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(人民币)	占基金资产净值比例(%)
原材料	0.00	0.00
非日常生活消费品	0.00	0.00
日常消费品	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
通讯业务	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

5、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	1,087.038249
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
期末基金总份额/期末基金实缴总额	1,087.038249

6、管理人报告

6.1 基金运作遵规守信情况

在本报告期内，本计划管理人在管理本计划过程中，严格遵守资产管理计划合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了管理人应尽的义务。

6.2 报告期内基金投资策略和业绩表现

在本报告期内，剔除管理人和投顾业绩报酬，本计划盈利 429070.39 元；本季度产生管理费 32224.48 元，托管及运营服务费 1464.76 元，投资顾问费 11717.99 元，税费及其他费用 10800.04 元，合计 56207.27 元。截止 2022 年 9 月 30 日本计划期末份额为 10870382.49 份，单位净值为 1.0932 元。

6.3 报告期内基金估值程序

根据中国证监会相关规定及资产管理计划合同约定，本计划管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和资产管理计划合同关于估值的约定，自行或委托第三方对本计划所持有的投资品种进行估值。本计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

6.4 报告期内基金运作情况和运作杠杆情况

本计划采用的 CTA 策略表现与标的的波动性成正比，报告期内，投资经理根据投资标的的波动性情况不断调整持仓，规避市场风险，努力实现产品投资目标。报告期内，本计划未使用杠杆。

6.5 报告期内投资收益分配和损失承担情况

本计划本报告期内未进行利润分配。

6.6 报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形

本报告期内，本计划设置了预警线及止损线，且在报告期间内，本计划未曾触及预警线及止损线。

6.7 报告期内可能存在的利益冲突

本报告期内，本计划未发生投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项。

6.8 报告期内其他说明情况

无

有限
业务
印章

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。

