

中证网讯（记者 周璐璐）近期，金瑞期货的一只相对价值策略产品“金瑞凤凰同心1号”捷报频传。据私募排排网官微4月21日发布的资管产品榜单，“金瑞凤凰同心1号”位列近半年相对价值策略榜首位；据4月22日全国期货实盘大赛的最新战报，“金瑞凤凰同心1号”同样以优异的表现继续保持着量化组综合得分第二位的好成绩。

金瑞期货相关人士介绍，近两年金瑞期货顺应行业发展形势，全新提炼了“发掘实体经济金融资源价值，追求产业链金融和谐共生”的企业使命。随着公司以经纪业务为基础，提供创新发展支撑，以风险管理业务和资产管理业务为双核的业务新格局确立，资产管理业务紧抓发展良机，综合实力显著增强。

作为大资管行业的后来者，期货公司资管业务起步较晚，发展道路并不平坦。在经历了资管新规的整顿期后，当前期货资管的特色逐渐显露，其规模得到快速回升。与此同时，金瑞期货也在积极探索资管业务的特色化发展新路径，基于期货公司资管对衍生品的深刻理解和合理运用，重点通过创新业务模式、丰富资管产品线，围绕期货及衍生品这一重心，着力打造具有竞争力的拳头产品，进一步丰富主动管理产品类型，持续推出不同类型的CTA、期权套利等多样化产品，确保资管业务持续稳健发展。

“今年一季度公司资产管理业务规模实现迅猛增长，从去年末的1.58亿元增长至今年3月末的2.68亿元，增幅达70%。接下来，金瑞期货的资管业务将始终坚持以商品及金融衍生品策略为核心，拓展多种风险收益特征策略的指导思想，继续加强目前主动管理策略产品的发行和规模扩张，同时注重不同策略的组合配置以满足不同风险收益偏好客户的需求，同时加大对固定收益类产品的研究和开发，以做大规模、做出品牌、做好口碑。”金瑞期货资管业务负责人张健祎表示。

提到“凤凰同心1号”的表现，张健祎介绍，“截至2022年3月末该产品成立以来的年化收益为9.8%，最大历史回撤0.23%，夏普比率5.95。”衡量一只基金产品的性价比，夏普比率、回撤率是两个重要的参考指标。其中夏普比率更是直接反映出了基金产品风险与收益的关系。而最大回撤率则可以判断买入某只基金后可能出现的最糟糕情况，回撤越大，风险越大；回撤越小，风险越小。

“凤凰同心1号”的优异表现是如何做到的？产品经理沈雁表示，“凤凰同心1号”的设计初衷是针对机构配置和风险偏好较为保守的合格投资人，做一个类固收较稳定的产品。以期权的无风险套利为基础，追求较高的收益回撤比值。通过自行研发的全程序量化交易系统，快速发现和利用市场上瞬间出现的期权合同之间的价格偏离机会进行套利。

而能够让“凤凰同心1号”表现如此亮眼，这背后离不开高速交易系统、先进硬件

条件作为关键技术的支持。金瑞期货一直重视IT技术实力的打磨与提升，这也是推动公司成功转型的强劲驱动力。据了解，目前公司的C++/CTP可以保证速度名列市场前沿，多年来公司全方位构建IT服务体系，所有交易硬件线路均采用热备份方式，出现灾难性情况可实时切换，100%不影响交易。

进入2022年，我国期货资管业务保持稳中向好的态势，金瑞资管业务也迎来了初战告捷。下一步，金瑞期货将继续提升金瑞资管的竞争力，在行业内凸显自身特色，树立起自己的品牌，促进资管业务结构的多元化，以满足不同客户的财富管理需求，真正做到用金融服务广大投资者与实体企业。