

# 瑞达期货-瑞智无忧共赢 1 号资产管理计划 2016 年第 4 季度报告

## 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	瑞达期货-瑞智无忧共赢 1 号资产管理计划
基金编码	S24201
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	2015 年 03 月 16 日
报告期末基金份额总额	17,060,403.50
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	本产品致力于通过覆盖多市场的多元化投资品种以及投资策略的多样性和灵活性，根据市场运行状态，采用多品种、多周期、多策略管理客户资产，通过调整投资品种结构比例，设置合理的风险控制级别，通过人工为主、结合系统信号的方式积极主动参与市场交易，实现以较少的投资风险来获取较多投资收益。
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	-0.74	-	-	-
自基金合同生效起至今	34.20	-	-	-

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	2016 年 10 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	147,789.86
本期利润	-111,403.96
期末基金资产净值	14,949,451.32
期末基金份额净值	0.8760

## 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	9,760,970.90	64.83
8	其他各项资产	5,295,045.40	35.17
	合计	15,056,016.30	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	29,187,430.53
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	12,127,027.03
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	17,060,403.50

#### 6、管理人报告

从整体来看，在第四季度主要产品系列的净值呈小幅回升的态势，主要得益于之前对策略的修复，目前基本上回归至“多策略、多周期，低风险、小回测”格局。伴随着市场变化，策略曾一度遭到挑战，效果远不及之前（2013-2015年），甚至部分产品出现较大的回撤的现象。但经过策略团队不懈的努力，在一系列的调整后，预计2017年整个策略效果要好于2016年，有望重振雄风。第四季度，金融股指维持之前策略，以股指期货来替代股票配置，并采用对冲策略，降低风险，金融股指继续维持对资产净值的贡献。经过前期大幅的上涨，对商品策略与资产配置，整体上采取更加谨慎策略，转向以对冲套利为主。从结果来看，商品系列策略整体上小幅回升，伴随着市场走势分化，预计2017年一季度整个产品策略表现会更好。