

# 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	开放式
基金合同生效日期	2015-04-21
报告期末基金份额总额	30,306,176.53
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	1.95	0	0	
自基金合同生效起至今	30.60	0	0	0

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	2016-10-01 至 2016-12-31
本期已实现收益	1,143,866.9

本期利润	1,130,416.56
期末基金资产净值	29,536,581.46
期末基金份额净值	0.975

#### 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	10,517,750.25	35.39
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	10,517,750.25	35.39
	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	19,203,570.87	64.61
8	其他	0.00	0.00
	合计	29,721,321.12	100.00

##### 4.2.1 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

#### 4.2.2 报告期末按行业分类的沪港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（%）
农、林、牧、渔业	0.00	0.00
采矿业	0.00	0.00
制造业	0.00	0.00
电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
建筑业	0.00	0.00
批发和零售业	0.00	0.00
交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
住宿和餐饮业	0.00	0.00
信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
金融业	0.00	0.00

房地产业	0.00	0.00
租赁和商务服务业	0.00	0.00
科学研究和技术服务业	0.00	0.00
水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
教育	0.00	0.00
卫生和社会工作	0.00	0.00
文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
综合	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上分类采用中国证券监督管理委员会制定的《上市公司行业分类指引》

## 5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	37,187,789.11
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	6,881,612.58
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	30,306,176.53

**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）

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。