

# 私募投资基金信息披露年度报表

## 1、基金产品概况

### 1.1 基金基本情况

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
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2015-04-21
基金管理人	瑞达期货股份有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
报告期末基金份额总额	30,306,176.53
基金合同存续期	2099-12-31

### 1.2 基金产品说明

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

### 1.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		瑞达期货股份有限公司	国信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	罗剑英	孙常新
	联系电话	0592-5950838	0755-22940646
	电子邮箱	rdqhzg2@163.com	03356@guosen.com.cn
传真		0592-5950281	0755-22940165
注册地址		厦门市思明区塔埔东路169号（观音山国际商务运营中心6号楼）13层	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址		厦门市思明区塔埔东路169号（观音山国际商务运营中心6号楼）13层	深圳市南山区学府路85号软件产业基地1栋A座22楼
邮政编码		361000	518061
法定代表人		林志斌	何如

### 1.4 信息披露方式

--

### 1.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	国信证券股份有限公司	深圳市南山区学府路 85 号软件产业基地 1 栋 A 座 22 楼
外包机构	国信证券股份有限公司	深圳市南山区学府路 85 号软件产业基地 1 栋 A 座 22 楼

## 2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	1,694,254.24	38,402,912.83	0.00
本期利润	780,833.10	39,302,930.24	0.00
期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-769,595.07	-2,317,604.93	0.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0254	-0.0184	0.0000
期末基金资产净值	29,536,581.46	124,828,206.24	0.00
期末基金份额净值	0.975	0.989	0.000
累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	-1.06	32.00	0.00

### 2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差 (选填)	业绩比较基准收 益率(选填)	业绩比较基准收 益率标准差(选填)
当年	-1.06			
自基金合同 生效起至今	30.60			

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=(本年度末累计净值-上年度末累计净值)/上年度末累计净值

### 2.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2015	0.3309	41,774,724.00	0.00	41,774,724.00	
2014	0.0000	0.00	0.00	0.00	

### 3、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	126,233,128.26
报告期期间基金总申购份额	5,017,205.02
减：报告期期间基金总赎回份额	100,944,156.75
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

**4、管理人说明的其他情况**（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作遵守信情况、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）

该基金管理人，2013年-2015年担任基金经理期间，任职期间产品业绩表现优异，2015年管理大多产品收益率50%以上。受股指期货限仓和模型问题，2016年管理部分产品业绩出现一定的回撤，基金管理人已通过多种方式调整模型，预计产品业绩在2017年有望稳定、回升。在投资策略上，严格按照合同规定，针对客户需求，采取“多策略、多周期、多品种”的模式，利用模型交易信号和主观研判相结合的方式。在具体策略上，宏观基本面上，2016年低估供给侧改革对期货市场的影响，致使未能有效抓住黑色与化工产品的趋势性行情，其中，一、二季度产品回撤力度较大，净值回撤稍大，三、四季度产品净值小幅回撤，业绩整体表现远不及于往年。2017年，按照当前宏观经济形势和市场表现来看，预计期货市场部分产品延续大波动格局，仍有较好市场投资机会。通过策略持续修正和瑞达期货研究院地支持，预计整体业绩有望得到改善。

### 5、托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵守信情况声明

托管人声明，在本报告期间，本基金托管人——国信证券股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基

金费用开支等问题上不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，遵守了《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。基金管理人本年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，遵守了《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

基金管理人本年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6、年度财务报表

### 6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末 2016-12-31	上年度末 2015-12-31
资产：		
银行存款	17,229.16	138,607.40
结算备付金	19,186,341.71	96,680,905.46
存出保证金	10,517,750.25	28,860,577.70
交易性金融资产	0.00	0.00
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00

递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	29,721,321.12	125,680,090.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016-12-31</b>	<b>上年度末 2015-12-31</b>
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	171,850.88	792,450.51
应付托管费	4,296.24	19,811.26
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	8,592.54	39,622.55
负债合计	184,739.66	851,884.32
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	30,306,176.53	126,233,128.26
未分配利润	-769,595.07	-1,404,922.02
所有者权益合计	29,536,581.46	124,828,206.24
负债和所有者权益合计	29,721,321.12	125,680,090.56

## 6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-04-21 至 2015-12-31
<b>一、收入</b>	<b>7,478,351.58</b>	<b>54,105,441.55</b>
1. 利息收入	21,756.58	55,996.55
其中：存款利息收入	21,756.58	55,996.55
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产利息收入	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	8,370,016.14	53,149,427.59
其中：股票投资收益	0.00	0.00

基金投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	8,370,016.14	53,149,427.59
股利收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-913,421.14	900,017.41
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	0.00	0.00
<b>减：二、费用</b>	<b>6,697,518.48</b>	<b>14,802,511.31</b>
1. 管理人报酬	1,487,898.07	1,954,076.93
其中：固定管理费	1,487,898.07	1,954,076.93
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	37,197.36	48,851.90
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	74,394.94	97,703.87
5. 交易费用	5,098,026.11	12,701,878.61
6. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产款支出	0.00	0.00
7. 其他费用	2.00	0.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>780,833.10</b>	<b>39,302,930.24</b>
减：所得税费用	0.00	0.00
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>780,833.10</b>	<b>39,302,930.24</b>

### 6.3 所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 (2016-01-01 至 2016-12-31)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	126,233,128.26	-1,404,922.02	124,828,206.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	780,833.10	780,833.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-95,926,951.73	-145,506.15	-96,072,457.88
其中：1. 基金申购款	5,017,205.02	-17,205.02	5,000,000.00

2. 基金赎回款	-100,944,156.75	-128,301.13	-101,072,457.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	30,306,176.53	-769,595.07	29,536,581.46
项目	上年度可比期间 (2015-04-21 至 2015-12-31)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	95,100,000.00	0.00	95,100,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	39,302,930.24	39,302,930.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	31,133,128.26	1,066,871.74	32,200,000.00
其中：1. 基金申购款	31,133,128.26	1,066,871.74	32,200,000.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	0.00	-41,774,724.00	-41,774,724.00
五、期末所有者权益（基金净值）	126,233,128.26	-1,404,922.02	124,828,206.24

## 7、期末投资组合情况

### 7.1 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	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：买断式回购的买入金融返售资产	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

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

备注：以上股票投资不含港股通。