

瑞达期货-瑞智无忧共赢 3 号资产管理计划 2016 年年度报告

年报

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	瑞达期货-瑞智无忧共赢 3 号资产管理计划
基金编号	S81930
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2015 年 10 月 19 日
基金管理人	瑞达期货股份有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
报告期末基金份额总额	12,476,964.23
基金到期日期	9999 年 12 月 31 日

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	-
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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗剑英
	联系电话	0592-5950838
	电子邮箱	rdqhzg@163.com
传真	0592-2397059	0755-82960794
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	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
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	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层

邮政编码	361000	518026
法定代表人	林志斌	宫少林

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	招商证券股份有限公司	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
外包机构	招商证券股份有限公司	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
---	-	-

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	-5,927,157.32	1,068,719.97	-
本期利润	-6,051,295.22	1,003,300.80	-
期间数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-1,510,620.43	1,124,666.08	-
期末可供分配基金份额利润	-0.1211	0.0271	-
期末基金资产净值总额	10,966,343.80	42,733,300.80	-
期末基金份额净值	0.8789	1.0282	-
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	-12.11%	2.82%	-

2.2 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(%)
当年	-14.52	-	-	-
自基金合同生效起至今	-12.11	-	-	-

注：净值增长率等于（期末净值-期初净值）/期初净值

当年净值增长率等于（本年度末净值-上年度末净值）/上年度末净值

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年	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2015年	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2014年	0.00	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	41,560,998.72
报告期间基金总申购份额	2,476,964.23
减：报告期间基金总赎回份额	31,560,998.72
报告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	12,476,964.23

4、管理人说明的其他情况

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规守信情况声明

本报告期，本托管人——招商证券股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本托管人按照基金合同的约定，对本基金报告期的基金资产净值进行了认真的复核；同时依据法律法规和基金合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内，托管人未发现报告期内管理人违反基金合同约定的事项。报告期内，本基金的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况”部分。

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

基于基金管理人提供的必要的估值要素，本托管人参照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的约定，对基金管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

金额单位：元

资产	2016/12/31	2015/12/31
资产：		
银行存款	76,684.40	0.00
结算备付金	7,598,470.56	30,337,502.44
存出保证金	3,417,517.25	12,574,997.40
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	11,092,672.21	42,912,499.84
负债和所有者权益	2016/12/31	2015/12/31
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	117,514.84	166,696.80
应付托管费	2,937.85	4,167.39

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	5,875.72	8,334.85
负债合计	126,328.41	179,199.04
所有者权益：		
实收基金	12,476,964.23	41,560,998.72
未分配利润	-1,510,620.43	1,172,302.08
所有者权益合计	10,966,343.80	42,733,300.80
负债和所有者权益总计	11,092,672.21	42,912,499.84

注：1、其他资产：未被统计进前列分类的资产科目，主要包括其他私募基金、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。

2、其他负债：未被统计进前列分类的负债科目，主要包括应付外包服务费、应付投资顾问费、应付咨询服务费等。

6.2 利润表

金额单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
一、收入	-4,284,751.65	1,491,370.00
1. 利息收入	3,148.35	0.00
其中：存款利息收入	3,148.35	0.00
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）	-4,163,762.10	1,556,789.17
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	-4,163,762.10	1,556,789.17
股利收益	0.00	0.00

其他收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-124,137.90	-65,419.17
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)	0.00	0.00
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	0.00	0.00
减：二、费用	1,766,543.57	488,069.20
1. 管理人报酬	720,335.71	166,696.80
其中：固定管理费	720,335.71	166,696.80
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	18,008.49	4,167.39
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 运营服务费	36,016.76	8,334.85
5. 交易费用	992,182.61	308,870.16
6. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融 资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	0.00	0.00
三、利润总额(亏损 总额以“-”号填列)	-6,051,295.22	1,003,300.80
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损 以“-”号填列)	-6,051,295.22	1,003,300.80

注：其他收益：未被统计进前列分类的损益类科目，主要包括投资于其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等产生的投资收益。

6.3 所有者权益变动表

金额单位：元

项目	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		
	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)	41,560,998.72	1,172,302.08	42,733,300.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	-6,051,295.22	-6,051,295.22
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)	-29,084,034.49	3,368,372.71	-25,715,661.78
其中：1. 基金申购款	2,476,964.23	23,035.77	2,500,000.00
2. 基金赎回款	-31,560,998.72	3,345,336.94	-28,215,661.78
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

(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	12,476,964.23	-1,510,620.43	10,966,343.80
项目	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年12月31日		
	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)	36,330,000.00	0.00	36,330,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	1,003,300.80	1,003,300.80
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)	5,230,998.72	169,001.28	5,400,000.00
其中: 1. 基金申购款	5,230,998.72	169,001.28	5,400,000.00
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(净值减少以“-”号填列)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	41,560,998.72	1,172,302.08	42,733,300.80

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	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	7,675,154.96	69.19
8	其他各项资产	3,417,517.25	30.81
	合计	11,092,672.21	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。

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