

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(份)	10,263,310.17
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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-351,358.41	588,589.99	1,694,254.24
本期利润	-372,159.83	510,335.47	780,833.10
期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-584,350.45	-380,943.00	-769,595.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0569	-0.0318	-0.0254
期末基金资产净值	9,678,959.72	11,583,304.86	29,536,581.46
期末基金份额净值	0.943	0.968	0.975
累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	34.50	37.00	30.60

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	-1.82			
自基金合同 生效起至今	34.50			

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
2018	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2017	0.0710	849,737.72	0.00	849,737.72	
2016	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	11,964,247.86
报告期期间基金总申购份额	1,133,786.85
减：报告期期间基金总赎回份额	2,834,724.54
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	10,263,310.17

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）

在风险可控前提下，尽量提高产品的净值，在策略上仍维持“多策略、多周期，低风险、小回测”思路。根据资管合同约定、资金规模以及市场状况等，适当的配置及调整相关策略，以求实现策略受益最优化。

2018年的实体经济，防风险工作坚决推进使得非标融资大幅收缩，叠加外部贸易摩擦所造成的出口转差、居民购房形成的高杠杆对内需的制约，令企业经营环境趋于恶化，经济增速稳中趋缓。数据显示，一、二、三季度GDP增速分别为6.8%、6.7%、6.5%，三季度GDP增速回落的降幅有所加大，生产和需求均表现疲弱，若四季度增速保持在6.5%，全年增速或在6.6%的水平。

当前经济总需求依然较弱，12月制造业PMI跌破荣枯线，为29个月来首次，11月工业企业利润负增长，显示经济下行压力不减。2019年宏观经济仍将面临下行压力，外贸、投资、消费三大需求整体均承压。一，外贸方面，目前进口持续强于出口的格局使得今年较去年贸易顺差收窄16.2%，顺差规模为2013年以来最低。四季度进出口同比增速较三季度有所回落，外部不确定性是最大担忧。预计未来在扩大对外开放、增加进口和“抢出口”效应消退，同时中美贸易战加征关税的负面影响将逐步显现的背景下，贸易顺差将延续收窄，外贸对经济增长的支撑可能难以在中短期内出现明显改善。二，投资方面，随着地方基建投资拉开序幕，基建投资有望托底经济，但在地方隐性负债增长受限的背景下，未来基建投资回升幅度可能较为有限；房地产投资增速目前面临着土地购置费延期支付支撑减弱、销售增速逐步走弱的双重压制；制

制造业投资的回升则可能存在企业被动加大污染防治相关投资的短期因素，再考虑到目前社融增速持续走低、货币政策的传导机制仍不顺畅，制造业投资增速回升的持续性也还需进一步关注。三，消费方面，由于前期居民加杠杆买房提前透支消费，且经济下行对消费产生抑制，消费增速也将趋于下行。

但宏观政策强化逆周期调节，货币和财政政策开始双双发力稳增长。货币政策方面，2018年以来央行多次降准、多次增加再贷款及再贴现额度、并创设 TMLF 工具，2019 年伊始，央行宣布全面降准，促进信贷投放，政策托底经济意图明显。财政政策方面，减税降费重磅措施接连落地。在亿万百姓开始享受“个税专项附加扣除”减税红利的同时，小微企业迎来了一批新的普惠性减税措施，每年可再减负约 2000 亿元。这释放了明确信号，即今年减税降费力度将继续加大并将加快落实，更为明显的降费措施也有望逐步推出。

尽管经济仍在下行，但 2020 为百年计划重要关键点，政府政策值得期待。在结构性松信用、松货币、宽财政的作用下，社融和基建数据有望在四季度与 2019 年上半年出现企稳、甚至反弹。

在经济走弱前提下，外加四季度外盘拖累，A 股持续下行，屡创新低。其中，2018 年第四季度，主要受外盘拖累，沪深 300 指数、中证 500、上证 50 三大股指下挫约 12%。伴随中美贸易干扰减弱和全球性经济走弱，商品整体上也呈现整体性下跌，其中，原油、农产品（如，豆粕）、工业品等出现较大幅度下挫。从历史统计数据来看，全球性资本市场权益类（股指）与商品类走势整体上具有一致性。但在全球性权益性风险集中快速释放和稳经济政策推出，尤其是，2019 年关键年，3 月份中国“两会”召开，将为资本市场与大宗商品注入一定的动力。

在金融股指方面，战略性看多股指，在稳杠杆政策托底下，尤其是在科创板出台前，监管层稳定或提振资本市场动机更强烈，外加“两会”营造、海外资金进入等，将提升投资者风险偏好，均为估值修复带来正面效应。2019 年一季度，A 股存在弱势反弹的需要，长期资金介入价值投资。在金融国债方面，央行在加大投入市场资金同时，国债期货一季度前期可能继续震荡上行，后期在地方债发行加大，及资金缓和，国债或存回归需要。

商品方面：相较于股指，商品走势分化更加明显，行业政策对品种影响更加显著。在经济刺激和利好环境营造下，工业品有望迎来震荡回升态势；受多种要素影响，原油走势将更加复杂，并带动化工产品波动。经过中美贸易战过山车式行情后，农产品可能再度回归震荡趋势。整体来看，较之往年，预计一季度商品整体波动会下降。

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

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》及其他有关法律法规、基金合同的规定，尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人对基金管理人的投资运作进行了必要监督，对资产净值的计算、利润分配、基金费用开支等业务进行了认真复核，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、投资组合情况等财务数据内容真实、准确和完整。

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末 2018-12-31	上年度末 2017-12-31
资产：		
银行存款	1,216.99	10,208.72
结算备付金	7,544,790.67	4,328,059.65
存出保证金	2,136,897.50	7,318,080.30
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	9,682,905.16	11,656,348.67
负债和所有者权益	本期末 2018-12-31	上年度末 2017-12-31
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	0.00	67,947.70
应付托管费	1,315.14	1,698.70
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	2,630.30	3,397.41
负债合计	3,945.44	73,043.81
所有者权益：		
实收基金	10,263,310.17	11,964,247.86
未分配利润	-584,350.45	-380,943.00
所有者权益合计	9,678,959.72	11,583,304.86
负债和所有者权益总计	9,682,905.16	11,656,348.67

6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2018-01-01 至 2018-12-31	2017-01-01 至 2017-12-31
一、收入	-74,900.85	2,328,109.40
1. 利息收入	25,759.15	2,034.40
其中：存款利息收入	25,759.15	2,034.40
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）	-79,858.58	2,404,329.52
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	-79,858.58	2,404,329.52
股利收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-20,801.42	-78,254.52
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
减：二、费用	297,258.98	1,817,773.93
1. 管理人报酬	0.00	355,901.90
其中：固定管理费	0.00	355,901.90
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	5,280.66	8,897.42

3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	10,560.98	17,795.21
5. 交易费用	281,417.34	1,435,179.40
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）	-372,159.83	510,335.47
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-372,159.83	510,335.47

6.3 所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 (2018-01-01 至 2018-12-31)		
	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）	11,964,247.86	-380,943.00	11,583,304.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-372,159.83	-372,159.83
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）	-1,700,937.69	168,752.38	-1,532,185.31
其中：1. 基金申购款	1,133,786.85	-133,786.85	1,000,000.00
2. 基金赎回款	-2,834,724.54	302,539.23	-2,532,185.31
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）	10,263,310.17	-584,350.45	9,678,959.72
项目	上年度可比期间 (2017-01-01 至 2017-12-31)		
	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）	30,306,176.53	-769,595.07	29,536,581.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	510,335.47	510,335.47
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）	-18,341,928.67	728,054.32	-17,613,874.35
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00

2. 基金赎回款	-18,341,928.67	728,054.32	-17,613,874.35
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	-849,737.72	-849,737.72
五、期末所有者权益(基金净值)	11,964,247.86	-380,943.00	11,583,304.86

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	9,682,905.16	100.00
8	其他	0.00	0.00
	合计	9,682,905.16	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末含行业分类的境内股票投资组合

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

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
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。

7.2.2 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

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
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

备注：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》

信息披露报告是否经托管机构复核：是