



瑞达期货-灯塔共赢 6 号集合资产管理计划 2023 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	瑞达期货-灯塔共赢 6 号集合资产管理计划
基金编码	SVS697
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2022 年 9 月 1 日
基金管理人	瑞达期货股份有限公司
基金托管人（如有）	申万宏源证券有限公司
投资顾问（如有）	-
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	2,247.678058
基金到期日期	2032 年 8 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	基于宏观以及产业逻辑与各频段的量价表现有机结合，寻求以商品期货对冲套利为主，并捕捉确定性较高的中长期投资机会。本策略采用“多品种、多周期、多策略”组合交易策略，根据宏观大势、板块和品种波动以及策略表现等，对各策略配置优化和动态仓位调整，并设置合理的风险控制级别，通过人机结合进行交易优化。本计划专注于商品期货交易，力求在严控风险基础上赚取更高的收益。
业绩比较基准（如有）	本基金无业绩比较基准。
风险收益特征	本基金属于【R4】风险投资品种。

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	申万宏源证券有限公司
信息披露 负责人	姓名	母静	陈琦
	联系电话	13850093186	010-88013567
	电子邮箱	rdqhzg2@163.com	chenqi6@swhysec.com
传真		-	-
注册地址		福建省厦门市思明区桃园路 18 号 26-29 层	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址	福建省厦门市思明区桃园路 18 号 26-29 层	北京市西城区太平桥大街 19 号
邮政编码	-	100033
法定代表人	林志斌	杨玉成

1.4 信息披露方式

--

1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	厦门市湖里区环岛干道万科云玺 2 号楼 B 座 7-9 楼
注册登记机构	申万宏源证券有限公司	北京市西城区太平桥大街 19 号
外包机构	申万宏源证券有限公司	北京市西城区太平桥大街 19 号
-	-	-

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

金额单位：元

期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-1,540,004.88	-79,746.52	0.00
本期利润	-1,187,845.44	-30,992.49	0.00
期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	0.00	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	0	0	-
期末基金净资产	21,700,582.00	13,970,426.95	0.00
报告期期末单位净值	0.9655	0.9958	-
累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率(%)	-3.45	-0.42	0

备注：

√无分级 □二级 □三级

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	-3.04	0.59	-	-
自基金合同生效起至今	-3.45	0.55	-	-

备注：

2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

年度	每份基金份额分红	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
2023	0	0.00	0.00	0.00	-
2022	0	0.00	0.00	0.00	-

备注：

3、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	1,402.958134
报告期期间基金总申购份额	2,448.378181
减：报告期期间基金总赎回份额	1,603.658257
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	2,247.678058

备注：

4、管理人说明的其他情况

1) 报告期内高管、基金经理及其关联基金经验：

本产品投资经理为林华。林华（期货从业资格：F3083771 基金从业资格：P1062364100002）

毕业于厦门大学软件工程专业。多年的国内外股票期货实战交易经验，专注策略研究、量化交易模型构建，对风险控制和投资组合管理有深入研究。投资策略涵盖了单边趋势，套利交易等，策略的投资周期也覆盖了从日内到月度的各个时间尺度，可以适应不同的市场环境。

2) 基金运作合规守信情况：

本报告期内，托管人根据《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，发现个别投资监督指标不符合基金合同的约定，并及时通知了管理人。报告期内，管理人在本基金的净值计算、基金份额申购赎回价格、基金费用开支及利润分配等情况上，托管人未发现管理人存在损害份额持有人利益的行为。

3) 基金投资策略：

本基金主要投资于以商品期货、金融期货等为代表的商品及金融衍生品相关资产。无特殊合同约定，本基金采取“多品种、多周期、多策略”组合模式，以相对均衡的配置分散投资风险，增加了基金资产抵抗风险的能力；同时，采用资金管理优势提升资产收益，达到“风险分散、盈利集中”的效果。

4) 基金业绩表现：

截止 2023 年 12 月 31 日，本基金期末基金单位净值为 0.9655 元，期末基金累计净值为 0.9655 元。

5) 对宏观经济、证券市场及其行业走势展望：

23 年全球经济展现出的韧性超出了市场预期，但在抗通胀和高利率环境下使得市场需求受到一定的抑制。相对而言，国内经济仍处于疫后修复的阶段，货币、财政、产业政策明显发力，但需求恢复较为缓慢的现象仍旧突出。在宏观大背景下，市场内上下游、境内外定价品种呈现出较为明显的分化走势，同时资金面因素对期货市场行情的影响亦有所体现，部分商

品价格波动在一定程度上偏离基本面因素。23 年宏观环境发生变化较为频繁，且经济前景的不确定性较强，地缘政治风险不降反升，使得市场波动规律及趋势性机会不显著，策略在该市场环境下表现较为一般。具体来看，23 年初市场对中国经济复苏持乐观态度，乐观情绪在一定程度上推动了市场对需求改善的预期，催化了节前商品、权益市场整体上行的表现。不过春节假期消费以及上半年经济数据表现不及市场预期，弱现实强预期，导致商品价格逐步回落。随着年中政府稳增长刺激政策持续出台，对市场情绪有所刺激，但下半年地产、基建表现疲软，出口动能未现起色，市场对经济前景的担忧带动国债收益率持续下行，而需求端不振对商品市场的表现总体较为负面。期间纯碱市场多空消息频繁发酵，同时资金博弈明显提升，价格连续上涨。四季度巴以冲突爆发，推动航运价格持续上涨，而市场对于美联储即将开启降息周期的预期同样升温，这也进一步带动了大宗商品价格的走高。报告期内，南华商品指数上涨 6.21%，沪深 300 指数下跌 11.38%。关于本基金的运作，CTA 仓位保证金占比维持在合理水平，因净值不同和根据市场波动情况，仓位存在差异。

6) 基金估值程序：

截止到报告期末，本管理人委托申万宏源证券有限公司为本基金提供估值核算服务。对于与基金资产有关的估值与会计核算问题，经相关当事人在平等基础上充分讨论后，达成一致意见。1、本基金成立前，本管理人协调本基金其他当事人商定本基金的估值与会计核算方法，并在合同中约定。2、在本基金的存续期内，本基金管理人定期评估基金估值与会计核算方法的合理性。3、在本基金的运作过程中，经济环境发生重大变化且对基金资产的估值产生重大影响的，由本管理人协调本基金其他当事人采取必要措施，调整估值方法。

7) 基金运作情况和运用杠杆情况：

截止报告期末，本基金资产总值为 21772985.84 元，净资产为 21700582.00 元，本基金总资产与净资产的比例为 1.00333649

5、 托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，申万宏源证券有限公司（以下称“托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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

本报告期内，托管人根据《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，发现个别投资监督指标不符合基金合同的约定，并及时通知了管理人。

报告期内，管理人在本基金的净值计算、基金份额申购赎回价格、基金费用开支及利润分配等情况上，托管人未发现管理人存在损害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

报告期内，托管人对管理人所编制和披露的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、份额变动情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6. 资产负债表

资产	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	0.21	208.37
结算备付金	15,762,686.63	10,733,872.67
存出保证金	6,010,299.00	3,271,995.15
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	21,772,985.84	14,006,076.19
负债和所有者权益	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
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	65,482.96	34,950.22
应付托管费	654.84	349.51
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	5,611.20	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	654.84	349.51
负债合计	72,403.84	35,649.24
所有者权益：		

实收资本	22,476,780.58	14,029,581.34
未分配利润	-776,198.58	-59,154.39
所有者权益合计	21,700,582.00	13,970,426.95
负债和所有者权益总计	21,772,985.84	14,006,076.19

备注:

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年9月1日至2022年12月31日
一、收入	776,148.68	192,161.43
1. 利息收入	483.68	1,841.43
其中：存款利息收入	483.68	1,841.43
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）	423,505.56	141,565.97
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	428,515.56	141,565.97
股利收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	352,159.44	48,754.03
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	1,963,994.12	223,153.92
1. 管理人报酬	217,897.43	45,305.46
其中：固定管理费	216,606.45	45,305.46
业绩报酬	1,290.98	0.00
2. 托管费	2,165.94	453.08
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	2,165.94	453.08
5. 交易费用	1,734,863.61	176,942.30
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	6,901.20	0.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,187,845.44	-30,992.49
减：所得税费用	0.00	0.00

四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-1,187,845.44	-30,992.49
-----------------------	---------------	------------

备注：
暂估业绩报酬2023年6.19

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2023年1月1日至2023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)	14,029,581.34	-59,154.39	13,970,426.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	-1,187,845.44	-1,187,845.44
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)	8,447,199.24	470,801.25	8,918,000.49
其中：1.基金申购款	24,483,781.81	-283,781.81	24,200,000.00
2.基金赎回款	-16,036,582.57	754,583.06	-15,281,999.51
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)	22,476,780.58	-776,198.58	21,700,582.00
项目	上年度可比期间 2022年9月1日至2022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)	11,001,419.44	0.00	11,001,419.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	-30,992.49	-30,992.49
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)	3,028,161.90	-28,161.90	3,000,000.00
其中：1.基金申购款	3,028,161.90	-28,161.90	3,000,000.00
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)	14,029,581.34	-59,154.39	13,970,426.95

备注：

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

项目	金额
现金类资产	银行存款 0.21
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资 0
	其中：优先股 0
	其他股权类投资 -
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资 0
新三板投资	新三板挂牌企业投资 0
境内证券投资规模	结算备付金 15,762,686.63
	存出保证金 6,010,299
	股票投资 0
	债券投资 0
	其中：银行间市场债券 0
	其中：利率债 0
	其中：信用债 0
	资产支持证券 0
	基金投资（公募基金） 0
	其中：货币基金 0
	期货及衍生品交易保证金 6,010,299
	买入返售金融资产 0
	其他证券类标的 -
资管计划投资	商业银行理财产品投资 -
	信托计划投资 -
	基金公司及其子公司资产管理计划投资 -
	保险资产管理计划投资 -
	证券公司及其子公司资产管理计划投资 -
	期货公司及其子公司资产管理计划投资 -
	私募基金产品投资 -
	未在协会备案的合伙企业份额 -
另类投资	另类投资 0
境内债权类投资	银行委托贷款规模 -
	信托贷款 -
	应收账款投资 -
	各类受（收）益权投资 -
	票据（承兑汇票等）投资 -

其他债权投资	-
境外投资	0
其他资产	-
债券回购总额	0
融资、融券总额	0
其中：融券总额	0
银行借款总额	0
其他融资总额	-

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按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
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：

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
地产建筑业	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

备注：

以上分类采用全球行业标准（GICS）。

8、信息披露报告

信息披露报告是否经托管机构复核：是



托管业务专用章仅代表对该报告财务数据的复核确认（但不包括管理人报告页/管理人说明的其他情况页）及托管人报告内容的确认