

《瑞达期货-瑞智原油增强 1 号集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-瑞智原油增强 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”），在基金业协会预备案产品编码为 **SJW978**。本计划为期货“一对多”资管业务，属管理型产品，无结构分级。

本计划为商品及金融衍生品类集合资产管理计划，主要投资于包括：1、商品及金融衍生品类：包括证券交易所及期货交易所上市的期权及期货；

2、其他类：包括证券公司收益凭证、债券回购、银行理财产品、现金、银行存款（包括活期存款、定期存款、协议存款和其他银行存款）、同业存单、公募基金（不包括分级基金 B）。

本产品主要采用原油指数增强策略，商品趋势追踪为辅的策略运作。以原油指数作为投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，辅以多元商品及策略组合，建构稳定绩效之投资组合，提高投资组合市场适应性。配合风控管系统，严密管理投资与交易风险，使产品取得回报报酬最大化。

1、原油指数增强策略：以基本面宏观经济分析为基础，结合商品供求关系得出大周期的持仓方向和数量，实战中再配合日内短线强弱对冲策略。

2、趋势追踪策略：以趋势交易为主，以原油期货的单边趋势交易为重点，原油行情较弱时辅以商品趋势交易。

3、套利交易策略：结合市场情绪分析，主要利用各品种之间的强弱相关性，做套利交易策略。

本计划份额自认购/参与之日（认购日为计划成立日、参与日为参与所对应开放日）起 6 个月（每月按 30 个自然日计算）内（含本数）不允许资产委托人申请退出。本资产管理计划开放日为本计划成立之日起每月 5 日（如遇节假日则顺延至下一个交易日）。

自 2020 年 4 月 2 日起向瑞达期货股份有限公司各营业部直销客户进行推广，截止 2020 年 4 月 24 日，推广期参与工作已经顺利结束。

此次推广的净参与金额为人民币 24,000,000.00 元，由个人投资者和机构投资者缴纳，有效参与户数为 19 户。按单位份额面值人民币 1.00 元计算，本计划推广期共参与 24,002,300.01 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-瑞智原油增强 1 号集合资

产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-瑞智原油增强 1 号集合资产管理计划投资说明书》的约定。

本计划自募集金额缴足之日起委托容诚会计师事务所（特殊普通合伙）进行验资，于 2020 年 5 月 8 日完成验资并出具验资报告。

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《瑞达期货-瑞智原油增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-瑞智原油增强 1 号集合资产管理计划投资说明书》的有关规定，本计划符合成立条件，于 2020 年 5 月 8 日成立。自成立日起，本计划管理人瑞达期货股份有限公司正式开始管理本计划资产。

现向中国证券投资基金业协会正式备案。

特此说明！

