

《瑞达期货冠优股指-有容天择 2 号集合资产管理计划》成立公告



瑞达期货冠优股指-有容天择 2 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”），在基金业协会备案产品编码为 SLL598。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：包括债券回购、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）。

本产品致力于股指期货权重增强型策略运作。利用股指期货多空皆宜的特性，灵活掌握长短期趋势，操作时可动态调整部位并顺势操作，使利润极大化，风险回撤极小化。同时配合多元商品及策略组合，透过策略组合互补，降低单一策略获利回调时的压力及投资风险，建构稳定绩效之投资组合，提高投资组合市场适应性。配合风险控管系统，严密管理投资与交易风险，并透过保护型投资策略，使产品取得回报报酬最大化。

1、股指趋势进取策略：以趋势交易为主，采用进取策略以技术分析为主要依据，捕捉市场短期热点，再结合部分风格稳健相对的技术信号，以股指期货的单边趋势交易为重点。

2、商品保护策略：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，并针对策略 1 做保护策略。

3、股指套利交易策略：结合市场情绪分析，利用上证 50、中证 500 和沪深 300 指数之间的强弱相关性，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 12 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周的第 1 个工作日。

自 2020 年 7 月 20 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 7 月 27 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 31,500,000.00 元，由个人投资者和机构投资者缴纳，有效参与户数为 3 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 31,500,525.00 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货冠优股指-有容天择 2 号集

合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货冠优股指-有容天择 2 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 7 月 30 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》、《瑞达期货冠优股指-有容天择 2 号集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货冠优股指-有容天择 2 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 7 月 30 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！

