

《瑞达期货-瑞泰 2 号集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-瑞泰 2 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 SGB348。本计划为期货“集合”资管业务，属管理型产品，无结构分级。

本计划为期货和衍生品类集合资产管理计划，主要投资于包括：

- （1）期货和衍生品类：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：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。

本计划的投资策略为：

1、商品期货：

以投资商品期货为主要标的，分散配置于多个高流动性商品，采用量化多因子 CTA 复合策略，包括量价趋势类策略，商品截面量化对冲类策略，基本面量化趋势类策略，特定波动率下的动量反转类策略，商品配对多空量化对冲类策略。

2、金融期货：

以投资股指期货、国债期货为主要标的，多周期的量价动量趋势策略。

3、策略特点：

（1）多策略多周期组合，品种和策略分散度高，各个策略净值表现之间具备低相关特征。整体组合收益曲线稳健。

（2）全市场波动率预警，策略净值曲线有下行右侧关闭的风险管控和择时开启跟踪处理，平衡处理各类策略的收益弹性和稳健回撤防守，力求在严格风控的基础上赚取更高的收益。

本资产管理计划开放日为本计划成立之后的每周二，如遇非交易日，则顺延至下一交易日。经管理人同意，委托人可退出持有期低于【180 天】的计划份额，未经管理人同意的，委托人不得退出持有期低于【180 天】的计划份额。

自 2023 年 05 月 25 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 2023 年 05 月 31 日，募集期参与工作已经顺利结束。

此次募集期参与金额人民币 10,000,000.00 元，由私募证券投资基金和管理人子公司瑞达新控资本管理有限公司共同缴纳，有效参与户数为 2 户，其中管理人子公司瑞达新控资本



管理有限公司的认购比例为 49.00%。按单位份额面值人民币 1.00 元计算，本计划募集期共参与 10,000,104.86 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-瑞泰 2 号集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-瑞泰 2 号集合资产管理计划投资说明书》的约定。

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-瑞泰 2 号集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-瑞泰 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 2023 年 06 月 01 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！

瑞达期货股份有限公司

2023 年 06 月 01 日

