

《瑞达期货-厦信灯塔集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-厦信灯塔集合资产管理计划（以下简称“本计划”），在基金业协会预备案产品编码为 SZD361。本计划为期货“集合”资管业务，属管理型产品，无结构分级。

本计划混合类集合资产管理计划，主要投资于包括：

（1）固定收益类资产：在银行间市场和交易所市场交易的债券、央行票据、资产支持证券、资产支持票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转债（含非公开）、可交换债（含非公开）、永续债、债券借贷、同业存单、存款（含结构性存款）、货币基金。

（2）期货和衍生品类资产：期货交易所上市的期货，不包括股指期货。

（3）其他类资产：现金、固定收益类资管产品（不包括私募基金）。

本计划的投资策略为：

根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化,对稳健资产(包括债券、货币市场工具等固定收益资产)与商品及金融衍生品类风险资产进行配置。利用期货及金融衍生品的多空机制和杠杆效应等，实现资产增值。

1、固定收益类投资的主要策略为：投资固定收益类资产，以获取稳定的低风险收益，以此来为产品提供安全垫。

2、投资于商品及衍生品类风险资产的主要策略为：

瑞达灯塔策略：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。基于宏观与利率波动情况下，必要时，配置少量适当的国债期货。

自本计划成立日（含）起的一年内为封闭期，封闭期内不接受参与和退出申请（临时开放日除外）。固定开放日为封闭期满后首个工作日以及之后每满 6 个月的对日，接受参与和退出申请，如对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

自 2023 年 06 月 19 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 06 月 19 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 52,500,000.00 元，由信托公司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 4.76%。按单位份额面值人民币 1.00 元计算，本计划募集期共参与 52,500,000.00 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-厦信灯塔集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-厦信灯塔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-厦信灯塔集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-厦信灯塔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 20 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！

