

《瑞达期货-烁石 2 号固收集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-烁石 2 号固收集合资产管理计划（以下简称“本计划”），在基金业协会备案产品编码为 SB0907。本计划为期货“集合”资管业务，属管理型产品，无结构分级。

本计划为期货公司固定收益类集合资产管理计划，主要投资于包括：

1、固定收益类资产：银行存款（包括但不限于定期存款、活期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、现金、证券交易所或银行间市场发行交易的债券、证券交易所或银行间市场发行交易的资产支持证券、银行间市场发行交易的资产支持票据、债券型公募基金、货币市场基金、债券逆回购、同业存单。

2、衍生品类资产：证券交易所及期货交易所上市的期权及期货、信用风险缓释凭证、信用保护凭证。

3、权益类资产：证券交易所发行上市的股票、股票型及混合型公募基金、港股通标的范围内的股票。

4、其他类：债券正回购、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金、银行及其子公司发行的理财产品、基金公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、公开募集基础设施证券投资基金，但不可投资于上述产品的劣后级份额。

本计划的投资策略为：

本计划为固收类集合资产管理计划，在投资过程中我们高度重视稳健投资策略的运用。通过宏观层面自上而下的分析，把握宏观经济基本态势和市场利率波动趋势，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。

本计划构建债券组合时，将具体采取利率预期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、替代互换选择策略和骑乘策略等积极投资策略，发现、确认并利用市场中存在的机会，实现组合稳定增值。同时，将根据组合流动性情况调整个券投资，保证核心债券组合的流动性。为提高投资回报率，本计划将积极进行信用债投资。

其他策略方面，本计划以“多品种、多周期、多策略”的衍生品（国债期货、商品期货及期权等）对冲套利策略为主，以期达到在更低回撤下的更高收益。



本计划份额每 3 个月（每月按 30 个自然日计算，算头不算尾，含满 3 个月当日）为锁定期。认购份额的“首个锁定期的起始日”为计划成立日，参与份额的“首个锁定期的起始日”为参与所对应开放日，份额的后续锁定期起始日为上一个锁定期结束后计划的第一个固定退出开放日。如计划份额未在锁定期过后的第一个固定退出开放日（K 日）赎回，则该份额从 K 日起继续锁定 3 个月，如此类推。

本计划参与开放日为每个自然月度 10 号、11 号、12 号、13 号、14 日，本计划固定退出开放日为每个自然月度的 18 号（上述开放日遇法定节假日均顺延至下一工作日，如顺延至同一工作日，则重合的开放日既可参与也可退出，重合的开放日只开放一个工作日）。

自 2023 年 07 月 04 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 07 月 24 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，由自然人委托人、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 6 户，其中我司有 1 名从业人员参与本计划，认购比例为 3.00%，管理人子公司瑞达新控资本管理有限公司的认购比例为 50%。按单位份额面值人民币 1.00 元计算，本计划募集期共参与 10,000,138.86 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-烁石 2 号固收集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-烁石 2 号固收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-烁石 2 号固收集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-烁石 2 号固收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 07 月 25 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 07 月 25 日