

《瑞达期货-同顺瑞达 1 号集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-同顺瑞达 1 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 SAPC09。本计划为期货“集合”资管业务，属管理型产品，无结构分级。

本计划为混合类集合资产管理计划，主要投资于包括：

（1）固定收益类：银行存款（包括但不限于定期存款、活期存款、协议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、债券回购、同业存单。

（2）期货和衍生品类：证券交易所及期货交易所上市的期货及期权。

（3）权益类资产：证券交易所发行上市的股票（包括但不限于新股申购、优先股、上市公司非公开发行股票）、港股通标的范围内的股票。

（4）其他类：公募基金、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金、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。

本计划的投资策略为：

本计划将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下地进行资产配置，在降低市场风险的同时追求更高的收益。

本计划投资策略为固定收益类资产投资策略与管理期货策略（CTA），包含：

（1）固定收益类资产投资策略通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，并在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策。在严格的风控基础上，力求实现资产稳健增值。

（2）CTA 策略以“多品种、多周期、多策略”的商品及衍生品（期货、期权）对冲套利策略为主，以期达到在更低回撤下的更高收益。

本计划致力于通过覆盖多市场的多元化投资品种以及投资策略的多样性和灵活性，管理客户资产；同时考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，尽力实现以较少的投资风险来获取稳健投资收益。

（3）根据宏观经济分析、大类资产配置策略，以商品波动率作为调整参考，当 Wind 商品指数年化波动率持续下降或持有商品很可能造成 CTA 收益下降时，基于委托人利益优先

原则，管理人相机决策适当提高固定收益类资产比例，本计划投资固定收益类的资产类别比例可能会阶段性超过 80%。

本计划设置不同的参与开放日、退出开放日（以下简称为 T 日或开放日）。本计划的参与开放日为基金成立之后的每周周三，如遇非交易日，则顺延至本周的下一交易日，如本周无下一交易日的，则本周不开放。本计划的退出开放日为基金成立之后的每月第 15 个自然日，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。

本计划由管理人瑞达期货股份有限公司与第三方代销机构浙江同花顺基金销售有限公司共同销售。募集开始日为 2024 年 09 月 25 日，完成募集日为 2024 年 11 月 22 日。

此次募集期参与金额人民币 10,089,856.45 元，由自然人委托人缴纳，有效参与户数为 18 户。按单位份额面值人民币 1.00 元计算，本计划募集期共参与 10,089,856.45 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-同顺瑞达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-同顺瑞达 1 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-同顺瑞达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-同顺瑞达 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 2024 年 11 月 26 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

2024 年 11 月 26 日