|  |  |
| --- | --- |
| 产品名称 | 瑞达期货-瑞智无忧共赢87号集合资产管理计划 |
| 产品预编码 | SB3015 |
| 管理人 | 瑞达期货股份有限公司 |
| 基金管理人组织形式 | 股份制 |
| 基金管理人备案信息 | 中国证监会颁发证监许可（2012）1722号文件核准瑞达期货股份有限公司资产管理业务资格 |
| 基金托管人 | 国泰君安证券股份有限公司 |
| 投资顾问 | 我司自主管理产品，无投资顾问 |
| 投资经理 | 张夕阳 |
| 产品类型 | 期货和衍生品类 |
| 产品类别 | 期货公司期货和衍生品类集合资产管理计划 |
| 风险收益特征 | 本资产管理计划属于【R4（中高）】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为【C4（积极）、C5（激进）】的普通合格投资者及专业投资者(本产品不接受风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者认购） |
| 投资策略 | 本计划依据宏观与产业的基本面逻辑和各个市场估值水平及波动情况，自上而下进行全市场全天候资产配置，以应对经济周期波动和单一市场局限，在风险可控前提下赚取超额收益。具体而言，本计划将以“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，并从资产轮动和风险收益比等角度择时配置权益类（股票）资产，必要时，增加一定的固定收益类现金管理工具，以期达到在更低回撤下的更高收益。 |
| 投资目标 | 在风险适度可控前提下，追求稳定、长期的适度收益。 |
| 存续期 | 10年 |
| 募集期间 | 自份额发售之日起60天内 |
| 封闭期 | 无 |
| 基金开放日 | 本计划成立之后每周周三、周五（如遇到非交易日，默认顺延至下一个交易日） |
| 预期募集规模 | 1000万 |
| 是否分级（结构化产品） | 否 |
| 投资范围 | 本计划的投资范围：（1）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等）、港股通标的范围内的股票；（2）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、债券回购、同业存单；（3）期货和衍生品类：证券交易所及期货交易所交易的期货和期权；（4）资产管理产品类资产：公募基金。 |
| 投资比例 | 1、本计划投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例（期货依合约价值、期权依合约面值，【非轧差】计算）绝对值合计不低于资产管理计划财产总值的80%，且期货和衍生品账户权益超过资产管理计划财产总值的20%；2、本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过200%；本计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算。 |
| 投资限制 | 1、按照穿透原则合并计算，本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；2、本计划管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；3、本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过计划资产净值的50%的，本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过120%。本计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述约定限制（托管人仅以现有能够获取的资讯数据为准进行监控，如与管理人数据存在不统一，以管理人提供数据及确认信息为准）；4、本计划不得投资于城投债。 |
| 产品成立条件 | 1、本资产管理计划的初始募集规模不得低于1000万元。2、本集合资产管理计划的投资者人数不少于二人，不得超过二百人。 |
| 认购/参与费用 | 无 |
| 赎回费用 | 无 |
| 管理费 | 1.5%/年 |
| 托管费 | 0.0075%/年 |
| 运营服务费 | 0.0075%/年 |
| 预警线 | 份额净值为0.55 |
| 清盘线 | 份额净值为0.50 |
| 收益分配 | 业绩报酬：产品收益在40%以下（含40%），管理人就该区间收益不提取业绩报酬；产品收益40%以上，管理人就该区间收益提取20%作为业绩报酬；1、本计划的收益分配可以采取【现金分红或红利再投资等方式】，【红利再投资是将现金红利按照计划分红除权日的计划份额净值自动转为计划份额】,本计划默认的收益分配方式为【红利再投资】，具体的分配方式以管理人的分红方案为准；2、计划收益分配后计划份额净值不能低于面值；即计划收益分配基准日的计划份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；3、本计划存续期内每6个月最多分红【1】次，实际收益分配比例、分配次数、分配时间和分配金额由管理人确定；4、每一计划份额享有同等分配权；5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 |