

《瑞达期货-上合智选 FOF 集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-上合智选 FOF 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 SAWY89。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【期货和衍生品类】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、债券逆回购、同业存单。

（2）期货和衍生品类资产：证券交易所及期货交易所上市的期权及期货、银行间市场金融衍生品（包括但不限于利率衍生品、汇率衍生品、债券衍生品和信用衍生品等）。

（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）资产管理产品类资产：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、银行及其理财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。

（5）其他：债券正回购。

本计划的投资策略为：

本计划以低敞口的套利策略为主要投资方向，并通过多产品、多策略分散投资，构建低波动、稳健的投资组合，以期平稳度过经济周期变换对产品的影响。此外，在构建稳健投资组合的同时，基于宏观经济周期等因素适当调整持仓结构，配置权益、固定收益类资产，以期达到适度增强组合收益的目标，力求在风险可控的前提下，实现收益稳健、适度增长。

本资产管理计划开放日为本计划成立之后的每周周二，如遇到非交易日，默认顺延至下一个交易日。

自 2025 年 05 月 27 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 2025 年 06 月 03 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，由自然人投资者缴纳，有效参与户数为 2 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 10,000,000.00 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-上合智选 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》及



《瑞达期货-上合智选 FOF 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-上合智选 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-上合智选 FOF 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 2025 年 06 月 04 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

2025 年 06 月 04 日

