

《瑞达期货-上合浔源 1 号 FOF 集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-上合浔源 1 号 FOF 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 SBPT56。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、基金中基金资产管理计划（FOF），主要投资于包括：

权益类资产：国内证券交易所上市交易的股票（不含非公开发行股票）、新股申购、通过港股通及其他交易互联互通机制投资的股票；

固定收益类资产：银行存款（包括定期存款、活期存款）、证券交易所或银行间市场发行交易的债券（均不包括非公开发行公司债）、证券交易所或银行间市场发行交易的资产支持证券（但不包括次级）、银行间市场发行交易的资产支持票据（但不包括次级）、债券逆回购、同业存单；

期货和衍生品类资产：期货、场内期权、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）；

资产管理产品类资产：公开募集证券投资基金、证券公司（含证券公司子公司）资产管理计划、期货公司（含期货子公司）资产管理计划、基金公司（含基金子公司）资产管理计划、银行理财产品、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的契约式私募投资基金，但不可投资于上述产品的劣后级份额。

其他：债券正回购。

本计划的投资策略为：

本资产管理计划以追求绝对收益、控制回撤为目标，运用大类资产配置的投资理念，以自上而下的宏观经济政策研究、大类资产研究和私募基金研究为研究方法，精选以私募基金为主的各类资产管理产品作为投资标的，部分仓位直接投资。产品严控下行风险，追求组合的长期稳健收益。

本计划开放日为每个自然周的周二（如遇非交易日顺延至下一个交易日）。

本计划为我司自主销售和自主管理型产品，不涉及第三方代销机构和第三方机构提供投资顾问服务。募集开始日为 2026 年 01 月 19 日，完成募集日为 2026 年 01 月 22 日。



此次募集期参与金额人民币 22,000,000.00 元，由自然人委托人共同缴纳，有效参与户数为 10 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 22,000,047.07 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-上合浔源 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-上合浔源 1 号 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-上合浔源 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-上合浔源 1 号 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 2026 年 01 月 23 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。

