

《瑞达期货-万利 2 号 FOF 集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-万利 2 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 SXD623。本计划为期货“集合”资管业务，属管理型产品，无结构分级。

本计划的投资类型为非结构化混合类基金中基金（FOF）集合资产管理计划，主要投资于包括：

- （1）商品及金融衍生品类：证券交易所及期货交易所上市的期权及期货；
- （2）权益类：全国交易所上市交易的股票、ETF 基金、港股通；
- （3）其他类：包括债券（包括银行间市场和交易所市场交易的各类债券、可转换债券、可交换债券等）、债券逆回购、现金、银行存款（包括活期存款、定期存款、协议存款和其他银行存款）、同业存单、公开募集证券投资基金（不包括分级基金 B）、私募基金管理人（协会登记）发行的证券投资类金融产品、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等。

本计划的投资策略为复合策略。

1、本计划将大部分资金投资于传统固定收益类资产，为整个计划取得一定的固定收益作为支撑，降低整体产品的收益波动；剩余部分资金在风险可控的前提下投资于收益更高、波动性更高的商品及金融衍生品资产，提高资金使用效率，以期获取稳定的超额收益。

2、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主要以债券为投资对象。本计划在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下精选固定收益类产品进行投资。力求在严格的风控基础上，求实现资产稳健增值。

（2）瑞达期货 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。

3、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。

自计划成立之日起，每满【12】个月对应日该月的最后三个工作日为固定【参与】开



放日，固定【参与】开放日投资者可以【参与】本计划；每满【12】个月后对应日该月的最后一个工作日为固定【退出】开放日，固定【退出】开放日投资者可以【退出】本计划；参与开放日和退出开放日重合时，投资者可以参与本计划，也可以退出本计划。

在本计划存续期内，除开放日外的期间为封闭期，在此期间管理人不接受委托人的参与和退出申请。

自2022年11月24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2022年12月20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10,400,000.00元，由自然人委托人和管理人瑞达期货股份有限公司共同缴纳，有效参与户数为21户，其中瑞达期货股份有限公司认购比例为13.46%。按单位份额面值人民币1.00元计算，本计划募集期共参与10,404,381.59份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-万利2号FOF集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-万利2号FOF集合资产管理计划投资说明书》的约定。

本计划自募集金额缴足之日起委托容诚会计师事务所（特殊普通合伙）进行验资，于2022年12月28日完成验资并出具验资报告。

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-万利2号FOF集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-万利2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2022年12月28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！

