

《瑞达期货-钩石 2 号固收集合资产管理计划》成立公告

瑞达期货-钩石 2 号固收集合资产管理计划（以下简称“本计划”），在基金业协会预备案产品编码为 SAFP40。本计划为期货“集合”资管业务，属管理型产品，无结构分级。

本计划为期货公司固定收益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、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、债券型公募基金、货币市场基金、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交易的衍生品（包括但不限于期货、期权等）、银行间市场发行交易的利率互换。

本计划的投资策略为：

本计划为利率增强型固收类集合资产管理计划，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。以宏观基本面分析为基础，以数量化分析模型为工具，合理配置风险，采用多种套利策略和投资方法，在降低市场风险的同时追求更高的收益。

在投资过程中通过对以利率债为主的固定收益资产的积极投资，在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。投资策略方面具体包括：利率品种投资策略、资产配置策略、杠杆套利策略、银行存款和同业存单投资策略、债券回购投资策略等。

本计划的策略通过对宏观经济、利率走势、资金供求、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。

本资产管理计划自成立日起【1 个月】内为封闭期，封闭期内不开放参与、退出；委托人可在本资产管理计划开放日参与、退出本资产管理计划。本资产管理计划开放日（以下简称 T 日或开放日）为本计划封闭期结束之后的每周二，如遇非交易日，则顺延至下一交易日。

自 2024 年 1 月 4 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 2024 年 2 月 5 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 10,100,000.00 元，由自然人委托人和单一资产管理计划共同缴纳，有效参与户数为 8 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 10,100,157.21 份。以上数据的计算和确定均严格遵守《瑞达期货-钧石 2 号固收集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-钧石 2 号固收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-钧石 2 号固收集合资产管理计划资产管理合同》及《瑞达期货-钧石 2 号固收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 2 月 6 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 2 月 6 日

