

## 瑞达期货-烁石 1 号集合资产管理计划

产品名称	瑞达期货-烁石 1 号集合资产管理计划
产品预编码	SXV440
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	无
投资经理	王骏翔
产品类型	混合类
产品类别	期货公司混合类集合资产管理计划
风险收益特征	<p>本计划为 R3（中）等级产品，适合风险识别、评估、承受能力为 C3（稳健）、C4（积极）、C5（激进）的合格投资者（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）</p> <p>本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，在降低市场风险的同时追求更高的收益。</p> <p>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：</p> <p>（1）固定收益类资产投资策略通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、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。</p> <p>（2）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。</p> <p>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。</p>
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	份额锁定 3 个月（每个投资人单独计算封闭期，以该投资人申购/认购日期计算）
基金开放日	每周二开放申购，封闭期后每月 15 日开放赎回（遇非交易日顺延至下一交易日）
预期募集规模	0.5 亿元

是否分级

否

(结构化产品)

本计划的投资范围:

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、衍生品类: 证券交易所及期货交易所上市的期权及期货、信用风险缓释凭证、信用保护凭证。

投资范围

3、权益类资产: 证券交易所发行上市的股票、股票型及混合型公募基金、港股通标的范围内的股票。

4、其他类: 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证券类私募基金、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、公开募集基础设施证券投资基金。

5、仅限于法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种。

6、管理人在取得相应资格后被允许投资的品种。

1、按照穿透原则合并计算所投资的底层标的, 本计划投资于固定收益类资产投资比例依【市值】合计低于资产管理计划财产总值的80%; 本计划投资于权益类资产投资比例依【市值】合计低于资产管理计划财产总值的80%; 本计划投资于商品及金融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)绝对值合计低于资产管理计划财产总值的80%, 或衍生品账户权益不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%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产;

3、本计划投资于资产管理产品的比例, 依市值计算, 合计不得高于资产管理计划资产总值的80%;

投资限制

4、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。同一资产的认定及计算方式: 股票、存托凭证、债券、资产支持证券、资产支持票据、同业存单、各类资产管理产品、债券逆回购按【单只证券或产品市值】进行计算; 期货、期权按占用保证金合计进行计算;

5、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;

6、本计划参与债券等证券发行申购时, 所申报的金额不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;

7、本基金持有的信用债组合, 其【市值加权平均剩余期限】不超过3年【(可转债、可交换债除外, 其中含权债到期日为最近一个行权日, 永续债到期日为下一续期选择权行权日)]; 信用债指除利率债(仅包括国债、地方政府债、政策

	性金融债及央行票据)外的其他债券品种,【含】同业存单及资产证券化产品;
	8、本计划所投信用债券债项评级(短期融资券、同业存单及资产证券化产品除外)需在AA(含)以上,短期融资债券债项评级需在A-1(含)以上,若无债项评级,主体评级或担保人需在AA(含)以上(中债资信评估有限责任公司的评级除外,不同评级机构出具的评级不一致的,以最新公布为准);
	9、本计划所投资产支持证券、资产支持票据债项评级不得低于AA级(中债资信评估有限责任公司的评级除外),不得投资除优先级以外的份额;
	10、本计划持有的单只债券,依【票面金额】计,不得超过其发行规模的【20】%;
产品成立条件	<p>1、本资产管理计划的初始募集规模不得低于5000万元。</p> <p>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。</p>
最低认购金额	40万元
参与费用	无
赎回费用	无
投顾费	无
托管费	0.01%/年
运营服务费	0.01%/年
预警线	份额净值为0.93
清盘线	份额净值为0.90
	2、管理人有权根据实际情况(如市场利率等因素)适当调整业绩报酬计提基准。
	3、在符合有关计划分红条件的前提下,管理人有权决定是否对计划进行收益分配,收益分配的比例亦由管理人决定,但收益分配频率为每6个月不超过1次。
收益分配	<p>4、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,若委托人持有份额的时间超过12个月,则可向管理人申请现金分红,具体的分配方式以管理人的分红方案为准;</p> <p>5、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;</p> <p>6、每一计划份额享有同等分配权;</p> <p>7、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</p> <p>8、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。</p>