瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:瑞达基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

送出日期:**2023** 年 **03** 月 **31** 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2022年5月17日（基金合同生效日）起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 21
7.3 净资产（基金净值）变动表 23
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 49
8.1 期末基金资产组合情况 49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 55
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 55
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 55
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 55
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 55

8.10 本基金投资股指期货的投资政策 56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 56
8.12 投资组合报告附注 56
§9 基金份额持有人信息 56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 58
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 58
§10 开放式基金份额变动 58
§11 重大事件揭示 59
11.1 基金份额持有人大会决议 59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 59
11.4 基金投资策略的改变 60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 60
11.8 其他重大事件 61
§12 影响投资者决策的其他重要信息 64
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 **20%**的情况 64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 64
§13 备查文件目录 64
13.1 备查文件目录 64
13.2 存放地点 65
13.3 查阅方式 65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	瑞达策略优选混合发起	
基金主代码	015694	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年05月17日	
基金管理人	瑞达基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,056,995.90份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	瑞达策略优选混合发起A	瑞达策略优选混合发起C
下属分级基金的交易代码	015694	015695
报告期末下属分级基金的份额总额	10,046,964.64份	10,031.26份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过对宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、市场走势以及市场流动性等进行综合分析，并结合回撤与风险管理要求，积极动态调整权益资产仓位。采用定量和定性相结合的方法进行资产配置，在严格控制风险的前提下，定期对投资组合类属资产进行优化，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		瑞达基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	韩鑫普
	联系电话	021-53308822	0755-82943666
	电子邮箱	kf@ruidaamc.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4009958822	95565
传真		021-53391131	0755-82960794
注册地址		厦门市思明区槟榔西里197号第一层448室	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心2508-2510	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码		200122	518000
法定代表人		徐志谋	霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ruidaamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	瑞达基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心2508-2510

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本期2022年05月17日（基金合同生效日）- 2022年12月31日	
	瑞达策略优选混合发起A	瑞达策略优选混合发起C
本期已实现收益	-1,276,369.92	-1,364.90
本期利润	-1,562,496.83	-2,066.10
加权平均基金份额本期利润	-0.1559	-0.1501
本期加权平均净值利润率	-15.96%	-15.18%
本期基金份额净值增长率	-15.56%	-14.67%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	
期末可供分配利润	-1,563,261.02	-1,471.94
期末可供分配基金份额利润	-0.1556	-0.1467
期末基金资产净值	8,483,703.62	8,559.32
期末基金份额净值	0.8444	0.8533
3.1.3 累计期末指标	2022年末	
基金份额累计净值增长率	-15.56%	-14.67%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金合同生效日为2022年5月17日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

瑞达策略优选混合发起A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	-6.41%	1.58%	1.70%	0.95%	-8.11%	0.63%
过去六个月	-17.19%	1.55%	-9.84%	0.85%	-7.35%	0.70%
自基金合同生效起至今	-15.56%	1.42%	-0.52%	0.86%	-15.04%	0.56%

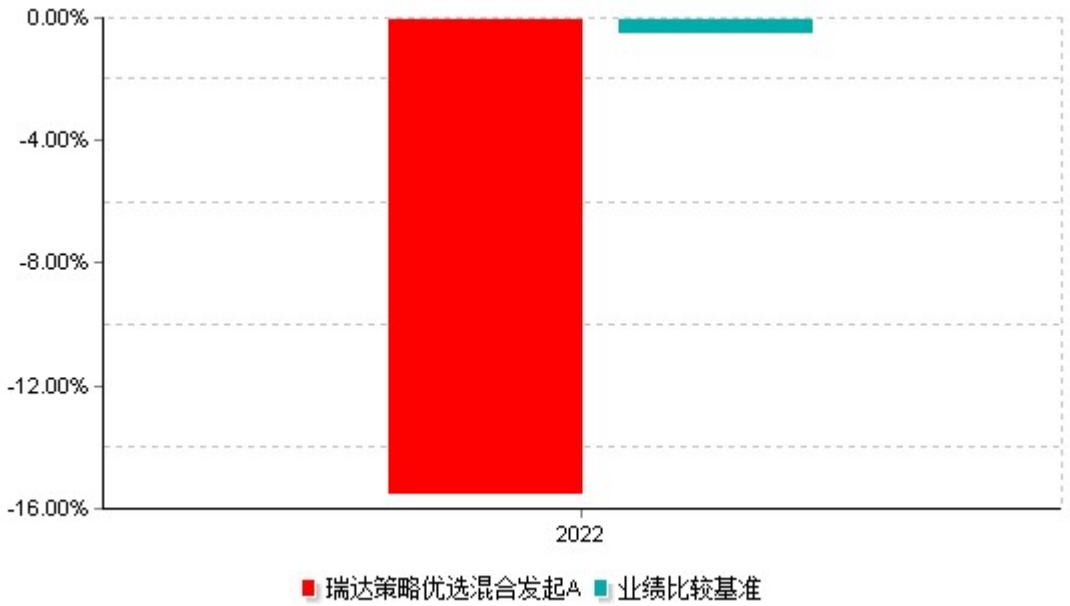
瑞达策略优选混合发起C

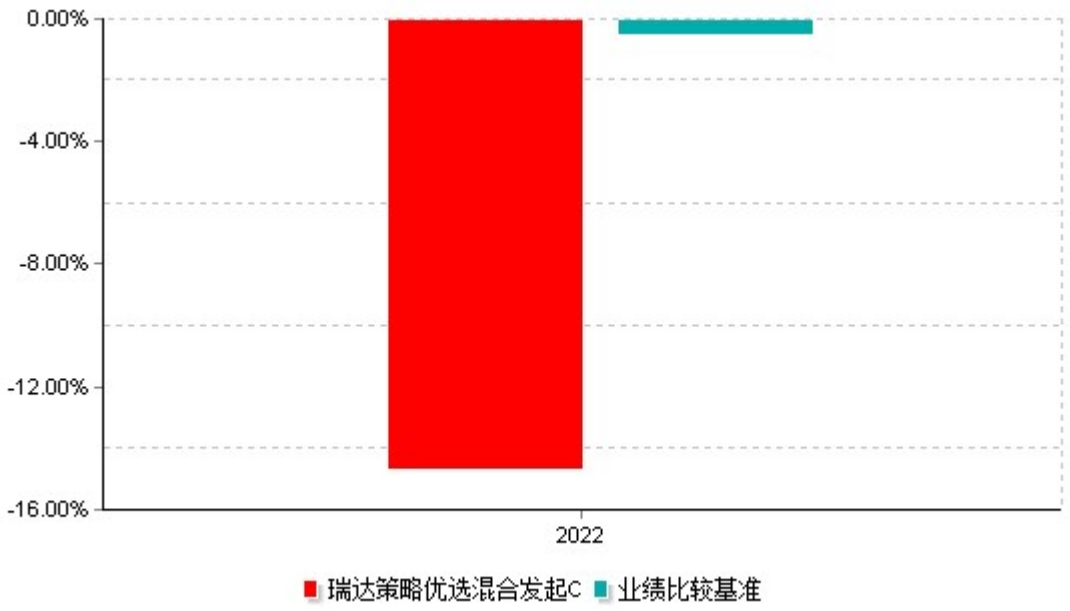
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.02%	1.58%	1.70%	0.95%	-7.72%	0.63%
过去六个月	-16.29%	1.55%	-9.84%	0.85%	-6.45%	0.70%
自基金合同生效起至今	-14.67%	1.43%	-0.52%	0.86%	-14.15%	0.57%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：（1）本基金的合同生效日为2022年05月17日，截止2022年12月31日不满1年；（2）根据基金合同约定，本基金建仓期为6个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2022年05月17日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

瑞达基金管理有限公司是经中国证监会批准成立的全国性基金管理公司。公司成立于2020年3月，注册资本为1.7亿元人民币，为瑞达期货股份有限公司（002961.SZ）100%持股子公司。获准经营的业务包括公开募集证券投资基金管理、基金销售。

截至2022年12月31日，公司旗下管理3只证券投资基金——瑞达行业轮动混合型证券投资基金、瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金、瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

袁忠伟	本基金的基金经理	2022-05-17	-	22	国籍：中国。 学历：北京工业大学管理科学与工程硕士。 从业资格：证券投资基金从业资格。 从业经历： 曾任苏州非金属矿工业设计研究院助理工程师、中国民族证券有限责任公司证券投资部总经理助理、华西证券股份有限公司资产管理部研究总监、英大基金管理有限公司权益投资部总经理、郑州明泉基金管理有限公司投资研究部投资总监、副总经理。2021年1月4日加入瑞达基金管理有限公司投资研究部担任投资总监。2021年6月9日至今任瑞达行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2021年7月14日至今任瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022年5月17日至今任瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的基金经理。
杜宇	本基金的基金经理	2022-11-02	-	5	国籍：中国。 学历：复旦大学数学科学学院金融硕士。 从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历： 曾任利安人寿保险股份有限公司权益研究岗、利安人寿保险股份有限公司权益投资岗。2022年1月10日

					加入瑞达基金管理有限公司投资研究部担任基金经理助理。2022年11月2日至今任瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；
2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；
3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求专门制订《瑞达基金管理有限公司公平交易管理制度》，结合《瑞达基金管理有限公司投资管理制度》、《瑞达基金管理有限公司投资管理权限及授权管理办法》、《瑞达基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司相关制度，规范公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

在研究分析、投资决策上，公司已建立客观、一致的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。在交易执行上，公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，并执行公平交易分配。在事后分析层面，公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部关于公平交易流程的各项制度规范。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的所有投资组合在研究分析、投资决策、交易执行、授权、业绩评估等投资管理活动各个环节均得到公平对待。本报告期内，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人严格执行公司异常交易监控与报告相关制度，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未出现超过该证券当日交易量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年是跌宕起伏的一年，市场经历了众多黑天鹅、灰犀牛事件。外部环境上，俄乌冲突爆发，战争复杂度、时间周期长度超过预期，美联储通胀韧性导致加息节奏和幅度均超预期；国内方面，以上海为代表的新冠疫情再次爆发，阻碍国内经济修复，地产步入下行周期，产业面临出清，12月国内防疫政策全面放开，经济经历一波短期阵痛。但让人惊喜的是，防疫放开后国内疫情在1个月内快速达峰，之后疫情对经济边际影响减小，国内经济正式步入疫后复苏轨道。在此背景下，2022年的市场大致经历了两波大幅度的超跌、反弹，股价波动相比往年明显放大。

本基金在6月初开始建仓，股票仓位逐月稳步提升，于8月提升到60%的水平。建仓初期，本基金根据宏观分析、市场判断和行业比较，选择将配置方向放在汽车、新能源、机械、电子等科技成长行业上，在6月-8月期间取得了良好的净值表现。但8月中下旬开始，市场对国内经济的担心明显放大，信心不足导致风险偏好短时间剧烈下行，作为新

成立基金，难以避免在仓位前低后高的情况下净值随之经历了一波较大幅度的回调。10月至年底，本基金股票仓位的波动中枢进一步提升到80%附近。配置方向上增加了少量如航空、白酒、家电等消费品种平抑净值波动，科技成长方向主要基于个股性价比做内部调整。在投资运作过程中，本基金灵活运用多种投资策略，保持建仓和调仓原则的一致性，根据宏观和中观行业比较，优选行业配置方向，同时结合自下而上分析优选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末瑞达策略优选混合发起A基金份额净值为0.8444元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.52%；截至报告期末瑞达策略优选混合发起C基金份额净值为0.8533元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-14.67%，同期业绩比较基准收益率为-0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年春节过后，对春节期间人员大规模流动可能导致疫情二次爆发的担忧解除。经文化和旅游部数据中心测算，今年春节假期全国国内旅游出游3.08亿人次，同比增长23.1%，恢复至2019年同期的88.6%；实现国内旅游收入3758.43亿元，同比增长30%，恢复至2019年同期的73.1%。观影、旅游为代表的消费有显著恢复。但地产方面，地产销售仍不乐观，春节返乡置业没有超预期表现，店访同比有增长但实际认购一般，地产仍较疲软的基本面与1月金融信贷数据相互印证。往后展望，一方面，预计国内稳经济尤其扩内需政策将在两会后陆续出台；另一方面，从国外经验来看，两轮疫情感染高峰大约相隔4-6个月，因此第一季度爆发大规模二次感染的可能性不大，且第二轮疫情峰值和影响经验角度比第一轮要低，叠加2022年二季度低基数和经济持续修复，2023年第二季度可能将是2023年全年经济表现较好的季度。

当前，制约2022年整年的几个因素如俄乌冲突、美联储加息、疫情等均有不同程度弱化，而国内政策相比海外更加友好。2023年市场环境相比2022年将有较大改善，市场随着经济修复有望迎来持续反弹。往后的关注重点将越来越聚焦经济基本面的疫后修复。决定股价的分子端“业绩”将随着经济见底迎来修复，分母端“友好的政策环境”也有利于风险偏好回升，当前估值水平处于历史较低位，展望新的一年，A股市场将更有可为。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人始终将加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效营业，保障基金持有人利益作为己任。报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，主要做了以下工作：

（一）加强合规风控文化建设，全面提升合规意识

本报告期内，针对业务开展情况以及年内新出台的法律法规，公司积极加强对各部门、各主要运作环节的监控，并通过组织修订完善公司制度流程、开展多层次的员工合规教育和日常提示、继续推进公司重大风险点排查和评估工作、严格的合规审核等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化以实现事前、事中和事后监控。

（二）完善内控制度，建立合规管理长效机制

本报告期内，为加强内控管理以及为各项业务工作的开展建立合规制度基础，公司制定、修订了多项制度和业务规则，同时全面贯彻执行现有制度流程，促成各项制度流程得到有效执行，保证公司的制度建设与业务开展进程相匹配。

（三）深入专项审计，提升内部风险防控能力

本报告期内，监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核，包括但不限于以下方面：信息技术、投资交易、反洗钱以及其他专项稽核等事项。实现对重要业务环节执行情况予以覆盖，对审计发现的问题进行动态追踪，督促相关部门认真整改。

（四）全面加强员工行为管理

本报告期内，公司严格执行防控内幕交易制度和从业人员证券投资申报等制度，强化员工行为管理工作，防范内幕交易和利益输送。

（五）深化反洗钱管理，推进反洗钱宣传

本报告期内，公司按照法律法规要求切实履行反洗钱职责，采取了一系列措施推动反洗钱工作全面铺开，于公司官网、微信公众号及办公场所开展形式多样的反洗钱宣传活动。为进一步提升反洗钱管理效能，对合规人员和公司全体员工进行了反洗钱培训，提升了合规人员的反洗钱工作技能和公司全体员工的反洗钱工作意识。

本基金管理人将不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(23)第P02087

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的利润表、净资产(基金净值)

	变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金2022年12月31日的财务状况以及2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	瑞达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公

	允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险；(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见；(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性；(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或

	情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金不能持续经营； (5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴凌志	胡本竞
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼	
审计报告日期	2023-03-31	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	2,135,713.42
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	6,524,239.60
其中：股票投资		6,524,239.60
基金投资		-

债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		8,659,953.02
负债和净资产	**附注号**	本期末 2022年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		11,195.52
应付托管费		1,492.73
应付销售服务费		1.83
应付投资顾问费		-

应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	155,000.00
负债合计		167,690.08
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	10,056,995.90
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-1,564,732.96
净资产合计		8,492,262.94
负债和净资产总计		8,659,953.02

注：1、报告截止日2022年12月31日，基金份额总额10,056,995.90份，其中瑞达策略优选A类基金份额净值人民币0.8444元，份额总额10,046,964.64份；瑞达策略优选C类基金份额净值人民币0.8533元，份额总额10,031.26份。

2、本基金基金合同于2022年5月17日生效。本期财务报表的实际编制期间为2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
一、营业总收入		-1,305,274.06
1.利息收入		15,994.56
其中：存款利息收入	7.4.7.9	12,478.03
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,516.53
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,034,692.90
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,041,811.35
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	7,118.45
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-286,828.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	252.39
减：二、营业总支出		259,288.87
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	91,651.55
2．托管费	7.4.10.2.2	12,220.20
3．销售服务费	7.4.10.2.3	17.12
4．投资顾问费		-
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．信用减值损失		-
7．税金及附加		-
8．其他费用	7.4.7.18	155,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,564,562.93
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,564,562.93
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,564,562.93

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	10,021,168.84	-	-	10,021,168.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	35,827.06	-	-1,564,732.96	-1,528,905.90
（一）、综合收益总额	-	-	-1,564,562.93	-1,564,562.93
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	35,827.06	-	-170.03	35,657.03
其中：1.基金申购款	87,150.87	-	-177.74	86,973.13
2.基金赎回款	-51,323.81	-	7.71	-51,316.10

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	10,056,995.90	-	-1,564,732.96	8,492,262.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

高峰	刘冬	王俊晔
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人瑞达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2022]768号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为10,021,168.84份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(22)第00222号的验资报告。基金合同于2022年5月17日正式生效。本基金的基金管理人为瑞达基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为A类基金份额(以下简称“瑞达策略优选混合发起A”)和C类基金份额(以下简称“瑞达策略优选混合发起C”)两类份额。其中，瑞达策略优选混合发起A是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；瑞达策略优选混合发起C是指在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(含同业存单)、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票及存托凭证的比例为基金资产的60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券

价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的金额确认，逐日确认债券利息并计入投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息并计入投资收益。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息并记入投资收益。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券投资收益。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除权除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

(5) 其他收入

在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后均不能低于面值；

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包

括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值；

2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值；

3)根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自2022年7月1日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)，并按相关衔接规定进行了处理。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90

号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
活期存款	75,279.48
等于：本金	75,273.45
加：应计利息	6.03
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-

存款期限3个月以上	-
其他存款	2,060,433.94
等于：本金	2,060,271.76
加：应计利息	162.18
减：坏账准备	-
合计	2,135,713.42

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,811,067.71	-	6,524,239.60	-286,828.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,811,067.71	-	6,524,239.60	-286,828.11

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产期末余额

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	15,000.00
预提费用-信息披露费	140,000.00
合计	155,000.00

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 瑞达策略优选混合发起A

金额单位：人民币元

项目 (瑞达策略优选混合发起A)	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,010,638.84	10,010,638.84
本期申购	48,164.58	48,164.58
本期赎回（以“-”号填列）	-11,838.78	-11,838.78
本期末	10,046,964.64	10,046,964.64

7.4.7.7.2 瑞达策略优选混合发起C

金额单位：人民币元

项目 (瑞达策略优选混合发起C)	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,530.00	10,530.00
本期申购	38,986.29	38,986.29
本期赎回（以“-”号填列）	-39,485.03	-39,485.03
本期末	10,031.26	10,031.26

注：1、本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

2、本基金自2022年5月12日至2022年5月13日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币10,021,168.84元，折合为10,021,168.84份基金份额(其中A类基金份额10,010,638.84份，C类基金份额10,530.00份)。根据《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币0.00元在本基金成立后，折合为0.00基金份额(其中A类基金份额0.00份，C类基金份额0.00份)，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 瑞达策略优选混合发起A

单位：人民币元

项目 (瑞达策略优选混合发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,276,369.92	-286,126.91	-1,562,496.83
本期基金份额交易产生的变动数	-2,519.89	1,755.70	-764.19
其中：基金申购款	-3,224.50	1,788.63	-1,435.87
基金赎回款	704.61	-32.93	671.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,278,889.81	-284,371.21	-1,563,261.02

7.4.7.8.2 瑞达策略优选混合发起C

单位：人民币元

项目 (瑞达策略优选混合发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,364.90	-701.20	-2,066.10
本期基金份额交易产生的变动数	186.94	407.22	594.16
其中：基金申购款	-1,405.72	2,663.85	1,258.13
基金赎回款	1,592.66	-2,256.63	-663.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,177.96	-293.98	-1,471.94

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	6,568.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,909.18
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	12,478.03

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	11,462,994.72
减：卖出股票成本总额	12,476,323.42

减：交易费用	28,482.65
买卖股票差价收入	-1,041,811.35

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,118.45
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,118.45

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-286,828.11
——股票投资	-286,828.11
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-286,828.11

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	252.39
合计	252.39

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	15,000.00
信息披露费	140,000.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	155,400.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
瑞达基金管理有限公司(“瑞达基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金托管人、基金销售机构
瑞达期货股份有限公司(“瑞达期货”)	基金管理人的控股股东
瑞达新控资本管理有限公司	受基金管理人控股股东控制的公司
厦门瑞达置业有限公司	受基金管理人控股股东控制的公司
瑞达国际金融股份有限公司	受基金管理人控股股东控制的公司
瑞达国际资产管理（香港）有限公司	受基金管理人控股股东控制的公司
瑞达国际金融控股有限公司	受基金管理人控股股东控制的公司
瑞达国际证券（香港）有限公司	受基金管理人控股股东控制的公司
瑞达国际开放式基金型公司	受基金管理人控股股东控制的公司
厦门瑞达源发供应链管理有限公司	受基金管理人控股股东控制的公司
厦门瑞达恒润投资有限公司	受基金管理人控股股东控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	30,750,385.85	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	7,900,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	14,653.47	100.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。基金托管人招商证券受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	91,651.55
其中：支付销售机构的客户维护费	72.35

注：支付基金管理人瑞达基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：
日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,220.20

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：
日托管费=前一日的基金资产净值×0.2%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	瑞达策略优选混合发起A	瑞达策略优选混合发起C	合计
瑞达基金	0.00	12.49	12.49
合计	-	12.49	12.49

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按基金前一日基金资产净值×0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
瑞达策略优选混合发起C的日销售服务费=前一日瑞达策略优选混合发起C基金资产净值×0.2%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

瑞达策略优选混合发起A

份额单位：份

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金合同生效日（2022年05月17日）持有的基金份额	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	99.53%

瑞达策略优选混合发起C

份额单位：份

项目	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金合同生效日（2022年05月17日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00

减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

注：（1)报告期末持有的基金份额占基金总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；
（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	2,060,433.94	5,909.18

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章和业务指引、细则、规范等四个层次的规章制度体系，建立了一套进行风险识别、评估、控制和报告的机制、制度和措施，围绕总体经营战略建立起覆盖公司投资、研究、销售和运营等业务流程的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了多层次的内部控制与风控体系，主要包括：(1) 董事会领导下的合规审计委员会的控制和指导；(2) 督察长领导下的监察稽核部风险控制岗的检查、监督；(3) 部门主管的检查监督；(4) 员工自律。

公司监察稽核部设立风险控制岗，专门负责投资管理风险控制监督工作，适时出具监督意见或风险建议；对于风险控制相关法律法规、规章制度、风险控制委员会决议的落实情况进行监督；对于投资关联交易以及其它风险相关事项进行检查监督。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,135,713.42	-	-	-	2,135,713.42
交易性金融资产	-	-	-	6,524,239.60	6,524,239.60
资产总计	2,135,713.42	-	-	6,524,239.60	8,659,953.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,195.52	11,195.52
应付托管费	-	-	-	1,492.73	1,492.73
应付销售服务费	-	-	-	1.83	1.83
其他负债	-	-	-	155,000.00	155,000.00
负债总	-	-	-	167,690.08	167,690.08

计					
利率敏感度缺口	2,135,713.42	-	-	6,356,549.52	8,492,262.94

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	6,524,239.60	76.83
交易性金融资产－基金投资	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-

衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	6,524,239.60	76.83

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022年12月31日
	1.中证800指数收益率上升5%	362,905.54
	2.中证800指数收益率下降5%	-362,905.54

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日
第一层次	6,524,239.60
第二层次	-
第三层次	-
合计	6,524,239.60

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,524,239.60	75.34
	其中：股票	6,524,239.60	75.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金	-	-

	融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,135,713.42	24.66
8	其他各项资产	-	-
9	合计	8,659,953.02	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,387,871.60	63.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	506,000.00	5.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	379,148.00	4.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	88,650.00	1.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	162,570.00	1.91
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,524,239.60	76.83

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603305	旭升集团	10,100	325,624.00	3.83
2	002965	祥鑫科技	4,900	285,229.00	3.36
3	603667	五洲新春	21,400	284,834.00	3.35
4	300775	三角防务	7,100	269,800.00	3.18
5	002126	银轮股份	20,800	258,128.00	3.04
6	603076	乐惠国际	6,400	235,520.00	2.77
7	002120	韵达股份	15,000	215,700.00	2.54
8	605128	上海沿浦	4,000	214,720.00	2.53
9	003043	华亚智能	3,300	201,267.00	2.37
10	300373	扬杰科技	3,800	199,880.00	2.35
11	301155	海力风电	2,100	183,435.00	2.16
12	002850	科达利	1,500	178,215.00	2.10
13	301278	快可电子	1,600	176,240.00	2.08
14	601636	旗滨集团	15,000	170,850.00	2.01
15	688022	瀚川智能	3,500	169,400.00	1.99
16	300660	江苏雷利	7,100	166,069.00	1.96
17	688131	皓元医药	1,500	162,570.00	1.91
18	603885	吉祥航空	10,000	161,800.00	1.91
19	300681	英搏尔	4,060	160,816.60	1.89
20	688120	华海清科	700	157,185.00	1.85
21	688262	国芯科技	3,700	154,697.00	1.82
22	301349	信德新材	1,400	154,644.00	1.82
23	603348	文灿股份	2,500	143,925.00	1.69
24	688320	禾川科技	3,000	140,400.00	1.65
25	301050	雷电微力	1,800	138,906.00	1.64

26	601021	春秋航空	2,000	128,500.00	1.51
27	688063	派能科技	400	126,260.00	1.49
28	300682	朗新科技	5,700	125,286.00	1.48
29	600456	宝钛股份	3,000	122,580.00	1.44
30	603997	继峰股份	8,000	122,240.00	1.44
31	300990	同飞股份	1,300	119,444.00	1.41
32	300911	亿田智能	2,500	115,350.00	1.36
33	603063	禾望电气	4,000	111,520.00	1.31
34	688596	正帆科技	3,000	101,850.00	1.20
35	603728	鸣志电器	3,000	99,990.00	1.18
36	688018	乐鑫科技	1,100	99,165.00	1.17
37	300629	新劲刚	3,500	89,460.00	1.05
38	600641	万业企业	5,000	88,650.00	1.04
39	002782	可立克	5,000	86,100.00	1.01
40	300438	鹏辉能源	1,000	77,990.00	0.92

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300681	英搏尔	529,578.00	6.24
2	603305	旭升集团	509,161.00	6.00
3	300755	华致酒行	455,143.00	5.36
4	688345	博力威	386,446.00	4.55
5	603667	五洲新春	362,094.00	4.26
6	688162	巨一科技	347,850.00	4.10
7	300750	宁德时代	331,222.00	3.90
8	688556	高测股份	322,726.35	3.80
9	002782	可立克	314,060.00	3.70
10	300775	三角防务	307,418.00	3.62

11	002960	青鸟消防	298,348.20	3.51
12	688100	威胜信息	283,320.00	3.34
13	300415	伊之密	275,315.00	3.24
14	688499	利元亨	259,637.00	3.06
15	688559	海目星	258,570.00	3.04
16	002531	天顺风能	258,117.00	3.04
17	002824	和胜股份	257,776.00	3.04
18	002126	银轮股份	251,138.00	2.96
19	002965	祥鑫科技	251,029.00	2.96
20	603348	文灿股份	249,340.00	2.94
21	300428	立中集团	248,937.00	2.93
22	301129	瑞纳智能	248,820.00	2.93
23	003043	华亚智能	248,319.00	2.92
24	002850	科达利	242,700.00	2.86
25	603076	乐惠国际	242,640.00	2.86
26	601021	春秋航空	242,360.00	2.85
27	605128	上海沿浦	241,280.00	2.84
28	688408	中信博	237,183.91	2.79
29	600641	万业企业	228,387.00	2.69
30	300957	贝泰妮	221,290.00	2.61
31	002120	韵达股份	218,750.00	2.58
32	688596	正帆科技	217,637.00	2.56
33	301046	能辉科技	215,791.00	2.54
34	688018	乐鑫科技	214,200.00	2.52
35	688005	容百科技	210,010.00	2.47
36	688022	瀚川智能	202,288.05	2.38
37	300432	富临精工	199,875.00	2.35
38	300499	高澜股份	199,713.00	2.35
39	002472	双环传动	199,331.00	2.35
40	300171	东富龙	198,763.00	2.34
41	603658	安图生物	197,794.00	2.33

42	301155	海力风电	197,773.00	2.33
43	300660	江苏雷利	197,706.88	2.33
44	601111	中国国航	197,677.00	2.33
45	300373	扬杰科技	196,680.00	2.32
46	603876	鼎胜新材	196,650.00	2.32
47	003038	鑫铂股份	195,650.00	2.30
48	300118	东方日升	175,572.00	2.07

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300755	华致酒行	386,473.00	4.55
2	688345	博力威	385,957.98	4.54
3	688556	高测股份	321,214.50	3.78
4	688162	巨一科技	320,017.00	3.77
5	603305	旭升集团	314,081.00	3.70
6	300681	英搏尔	296,286.00	3.49
7	300750	宁德时代	261,135.00	3.07
8	002960	青鸟消防	247,850.00	2.92
9	300415	伊之密	244,120.00	2.87
10	688408	中信博	237,851.04	2.80
11	688100	威胜信息	235,208.23	2.77
12	688005	容百科技	231,940.00	2.73
13	002531	天顺风能	229,332.00	2.70
14	002824	和胜股份	226,841.00	2.67
15	688559	海目星	210,250.00	2.48
16	300957	贝泰妮	206,400.00	2.43
17	688596	正帆科技	204,812.97	2.41
18	301129	瑞纳智能	201,903.00	2.38

19	300499	高澜股份	201,345.00	2.37
20	301046	能辉科技	200,720.00	2.36
21	300428	立中集团	194,040.00	2.28
22	688499	利元亨	193,710.00	2.28
23	002782	可立克	190,036.00	2.24
24	603658	安图生物	186,640.00	2.20
25	300432	富临精工	182,128.00	2.14
26	601111	中国国航	179,710.00	2.12
27	603876	鼎胜新材	177,255.00	2.09
28	300171	东富龙	176,078.00	2.07
29	003038	鑫铂股份	175,800.00	2.07
30	601021	春秋航空	173,764.00	2.05

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	19,287,391.13
卖出股票收入（成交）总额	11,462,994.72

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括浙江五洲新春集团股份有限公司。浙江五洲新春集团股份有限公司及相关人员由于存在信息披露违法违规的行为，于2022年3月22日收到上交所的口头警告。对以上事件，基金经理判断，浙江五洲新春集团股份有限公司经营稳健，本次处罚对公司影响可控。后续将继续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

注：其他各项资产期末无余额。

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
瑞达策略优选混合发起A	18	558,164.70	10,000,461.24	99.54%	46,503.40	0.46%
瑞达策略优选混合发起C	3	3,343.75	0.00	0.00%	10,031.26	100.00%
合计	21	478,904.57	10,000,461.24	99.44%	56,534.66	0.56%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	瑞达策略优选混合发起A	6,136.47	0.06%
	瑞达策略优选混合发起C	10,010.00	99.79%
	合计	16,146.47	0.16%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额;对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	瑞达策略优选混合发起A	0~10
	瑞达策略优选混合发起C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	瑞达策略优选混合发起A	-
	瑞达策略优选混合发起C	0~10
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	99.43%	10,000,000.00	99.43%	三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	99.43%	10,000,000.00	99.43%	三年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	瑞达策略优选混合发起A	瑞达策略优选混合发起C

基金合同生效日(2022年05月17日)基金份额总额	10,010,638.84	10,530.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	48,164.58	38,986.29
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	11,838.78	39,485.03
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,046,964.64	10,031.26

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于2022年4月8日公告，夏萌先生不再担任基金管理人总经理职务，同时由董事长李湧先生代任总经理职务，代为履行总经理职责。

2、基金管理人于2022年4月26日公告，夏萌先生不再代任基金管理人督察长职务，由胡囡女士代任督察长职务，代为履行督察长职责，同时担任副总经理职务。

3、基金管理人于2022年7月19日公告，夏萌先生不再担任基金管理人上海分公司负责人，同时由宋娴文女士担任上海分公司负责人职务。

4、基金管理人于2022年8月11日公告，胡囡女士不再担任基金管理人副总经理职务，同时胡囡女士由基金管理人代任督察长转任为督察长。

5、基金管理人于2022年10月1日公告，李湧先生不再代为履行基金管理人总经理职责，同时由高峰先生担任总经理职务，由刘冬先生担任首席信息官职务。

6、基金管理人于2022年10月19日公告，刘冬先生不再担任基金管理人首席信息官职务，同时由总经理高峰先生代任首席信息官职务，代为履行首席信息官职责。

7、基金管理人于2022年10月28日公告，李湧先生不再担任基金管理人董事长职务，同时由徐志谋先生担任董事长职务。

8、基金管理人于2022年12月28日公告，总经理高峰先生不再代任首席信息官职务，同时由陈戈先生担任副总经理兼首席信息官职务。

9、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务的诉讼。本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立起为本基金提供审计服务，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币15,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

本报告期内，上海证监局因现场检查对公司和相关人员出具了监管措施。我司已按法律法规和监管要求及时进行整改。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	2	30,750,385.85	100.00%	14,654.04	100.00%	-

注：（1）基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有

良好的声誉；2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。（2）基金交易单元的选择程序如下：1）本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；2）本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。（3）上述佣金包含经手费、证管费和过户费。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券股份有限公司	-	-	7,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-09
2	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金合同	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-09
3	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-09
4	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金托管协议	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-09
5	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金招募说明书	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-09
6	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-09

7	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-09
8	瑞达基金管理有限公司关于瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金提前结束募集的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
9	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-18
10	关于开放瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-29
11	瑞达基金管理有限公司上海分公司负责人变更的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-19
12	瑞达基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-11
13	瑞达基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-01
14	瑞达基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-19
15	瑞达基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-19

16	瑞达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2022-10-26
17	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金2022年第三季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-26
18	瑞达基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-28
19	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-02
20	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金招募说明书及产品资料概要更新的提示性公告	中国证券报	2022-11-04
21	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-04
22	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-04
23	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-04
24	瑞达基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-22
25	瑞达基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网	2022-12-28

		站	

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-05-17 至 2022-12-31	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	99.43%
产品特有风险							
本报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人巨额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险； 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额； 3、根据《基金合同》的约定，基金合同生效之日起3年后的对应日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或监管部门规定发生变化，上述终止规定被取消或更改的，则本基金可以参照届时有效的法律法规或监管部门的规定执行。《基金合同》生效满3年后继续存续的，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。因此，在极端情况下，当单一投资者大量赎回本基金后，可能造成基金资产净值大幅缩减，对本基金的继续存续产生决定性影响； 4、其他可能的风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的文件

2、《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金合同》

3、《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金托管协议》

4、《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批复、营业执照

6、基金托管人业务资格批复、营业执照

7、报告期内瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

8、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

上海市浦东新区福山路500号城建国际中心2508-2510室

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人营业时间免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：400-995-8822，公司网址：www.ruidaamc.com。

瑞达基金管理有限公司

二〇二三年三月三十一日