
瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金

2023年第4季度报告

2023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:华鑫证券有限责任公司

报告送出日期:2024年01月22日

§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。

基金托管人华鑫证券有限责任公司根据本基金合同规定，于2024年01月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年10月01日起至2023年12月31日止

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 瑞达鑫红量化6个月持有混合 |
| 基金主代码 | 012977 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021年07月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 47,138,227.06份 |
| 投资目标 | 本基金通过量化投资模型精选标的，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。 |
| 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500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。 |

| | | |
|-----------------|----------------|----------------|
| 基金管理人 | 瑞达基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 华鑫证券有限责任公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 瑞达鑫红量化6个月持有混合A | 瑞达鑫红量化6个月持有混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012977 | 012978 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 36,963,646.76份 | 10,174,580.30份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2023年10月01日 - 2023年12月31日) | |
|----------------|--------------------------------|----------------|
| | 瑞达鑫红量化6个月持有混合A | 瑞达鑫红量化6个月持有混合C |
| 1.本期已实现收益 | -2,262,871.51 | -525,130.11 |
| 2.本期利润 | -1,074,272.92 | -233,408.24 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0245 | -0.0228 |
| 4.期末基金资产净值 | 22,294,176.88 | 6,061,379.50 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.6031 | 0.5957 |

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。

3.2 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

瑞达鑫红量化6个月持有混合A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -3.46% | 0.73% | -3.51% | 0.69% | 0.05% | 0.04% |
| 过去六个月 | -6.64% | 0.67% | -7.31% | 0.68% | 0.67% | -0.01% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去一年 | -7.10% | 0.69% | -5.15% | 0.66% | -1.95% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | -39.69% | 1.10% | -15.97% | 0.88% | -23.72% | 0.22% |

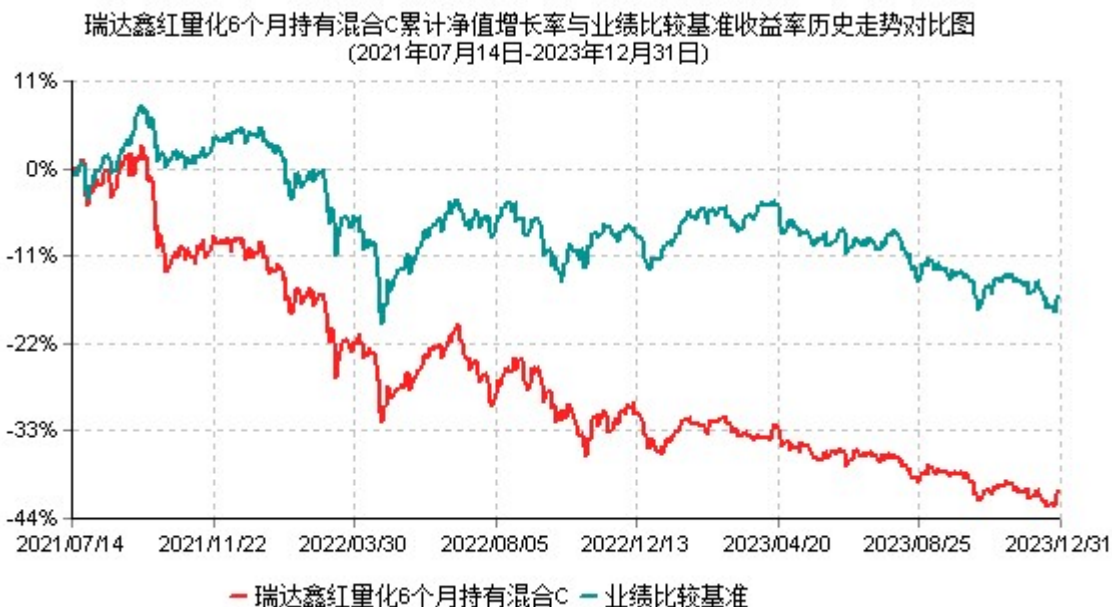
瑞达鑫红量化6个月持有混合C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -3.58% | 0.73% | -3.51% | 0.69% | -0.07% | 0.04% |
| 过去六个月 | -6.88% | 0.67% | -7.31% | 0.68% | 0.43% | -0.01% |
| 过去一年 | -7.57% | 0.69% | -5.15% | 0.66% | -2.42% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | -40.43% | 1.10% | -15.97% | 0.88% | -24.46% | 0.22% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

瑞达鑫红量化6个月持有混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年07月14日-2023年12月31日)





注：本基金的合同生效日为 2021 年 07 月 14 日。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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | 2021-07-14 | - | 23 | 国籍：中国。学历：北京工业大学管理学硕士。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。 |
|--|--|--|--|--|--|

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行业协会相关规定。

4.1.1 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

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。

4.2 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 公平交易专项说明

4.3.1 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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

从估值水平分析，沪深300、中证500、中证800、MSCI指数基本处于同一水平。宏观经济增速低位徘徊、人民币汇率企稳、利率水平下移、股市估值水平合理、A股日成交金额基本在1万亿以下波动等基本面使A股市场较长时间处于区间震荡之中。

本基金量化投资采取如下策略：股票组合在行业分布方面进一步分散，单一行业投资比例不超过组合市值的10%；个股投资比例控制在基金净值的2%以下；股票平均仓位保持在80%以下。通过精选各行业内优质公司，有效降低组合的整体估值水平，股票组合整体抗风险水平明显提高。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末瑞达鑫红量化6个月持有混合A基金份额净值为0.6031元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.46%，同期业绩比较基准收益率为-3.51%；截至报告期末瑞达鑫红量化6个月持有混合C基金份额净值为0.5957元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.58%，同期业绩比较基准收益率为-3.51%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形，基金管理人以通讯方式召开了瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并于11月2日在指定媒介上披露了《关于瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 26,392,060.00 | 91.66 |
| | 其中：股票 | 26,392,060.00 | 91.66 |
| 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 | 2,402,201.58 | 8.34 |
| 8 | 其他资产 | 9.99 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 28,794,271.57 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 3,918,100.00 | 13.82 |
| C | 制造业 | 13,035,500.00 | 45.97 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 502,740.00 | 1.77 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,694,140.00 | 9.50 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,444,080.00 | 8.62 |
| J | 金融业 | 3,270,300.00 | 11.53 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 527,200.00 | 1.86 |

| | | | |
|---|----|---------------|-------|
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 26,392,060.00 | 93.08 |

5.2.2 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港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 000034 | 神州数码 | 44,000 | 1,316,040.00 | 4.64 |
| 2 | 000063 | 中兴通讯 | 48,000 | 1,271,040.00 | 4.48 |
| 3 | 002929 | 润建股份 | 30,000 | 1,251,900.00 | 4.42 |
| 4 | 002128 | 电投能源 | 80,000 | 1,141,600.00 | 4.03 |
| 5 | 600438 | 通威股份 | 44,000 | 1,101,320.00 | 3.88 |
| 6 | 601699 | 潞安环能 | 50,000 | 1,095,500.00 | 3.86 |
| 7 | 600089 | 特变电工 | 76,000 | 1,048,800.00 | 3.70 |
| 8 | 601838 | 成都银行 | 90,000 | 1,013,400.00 | 3.57 |
| 9 | 001308 | 康冠科技 | 36,000 | 1,007,280.00 | 3.55 |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 150,000 | 1,003,500.00 | 3.54 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括江苏银行股份有限公司。江苏银行股份有限公司由于报送的互联网保险业务数据不真实、未按规定披露互联网保险信息，于2023年08月10日收到了国家金融监督管理总局江苏监管局行政处罚决定书(苏金罚决字〔2023〕2号)。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|-------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 9.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|------|
| 8 | 合计 | 9.99 |
|---|----|------|

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 瑞达鑫红量化6个月持有混合A | 瑞达鑫红量化6个月持有混合C |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 47,105,206.62 | 10,455,037.78 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 33,787.39 | 27,703.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 10,175,347.25 | 308,160.48 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 36,963,646.76 | 10,174,580.30 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 瑞达鑫红量化6个月持有混合A | 瑞达鑫红量化6个月持有混合C |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 7,223,345.85 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 7,223,345.85 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.00 | 0.00 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|--------------|--------------|------|
| 1 | 赎回 | 2023-12-11 | 7,223,345.85 | 4,305,114.13 | 0 |
| 合计 | | | 7,223,345.85 | 4,305,114.13 | |

注：按照《瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本基金对每份基金份额设置6个月的最短持有期限，本基金不收取赎回费用。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本报告期内，无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金的文件
- 2、《瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、瑞达基金管理有限公司的业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、报告期内瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

9.2 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

9.3 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

2024年01月22日