
瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09月30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:2021年10月26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2021年10月21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2021年07月14日起至2021年09月30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 | 260,796,960.24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 | 217,319,943.22份 | 43,477,017.02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(2021年07月14日 - 2021年09月30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 | -9,790,134.39 | -1,986,925.42 |
| 2. 本期利润 | -17,584,252.14 | -3,527,416.56 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0842 | -0.0847 |
| 4. 期末基金资产净值 | 199,608,099.46 | 39,890,934.83 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9185 | 0.9175 |

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 |
|--------|--------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 自基金合同生 | -8.15% | 1.41% | 1.93% | 0.93% | -10.08% | 0.48% |

| | | | | | | |
|----------|--|--|--|--|--|--|
| 效起 至今 | | | | | | |
|----------|--|--|--|--|--|--|

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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -8.25% | 1.41% | 1.93% | 0.93% | -10.18% | 0.48% |

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-2021年09月30日)



瑞达鑫红量化6个月持有混合C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-2021年09月30日)



注：（1）本基金的合同生效日为2021年07月14日，截止2021年09月30日不满一年。

（2）根据基金合同约定，本基金的建仓期为6个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在6个月建仓期结束时，确保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 | - | 20 | 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01月04日加入瑞达基金管理有限公司投资部担任投资总监。2021年06月09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07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。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

针对A股市场公司数量规模化、行业细分化、行情轮动化的特点，本基金采取中证500指数量化增强的投资策略。在股票组合构建方面，基于大数据和机器学习的指数量化增强研究，通过量化模型在全市场范围内刷选出合理的且在下一周期整体表现强于指数的股票组合。量化模型通过对二级市场成交的低频量价数据、日内高频Tick数据、Wind提供的基本面数据和财务数据、以及财经相关的各类资讯和行研数据，使用校对、补齐、归一化、去极值化、线性回归等手段进行加工处理，用各种数学方式将基础数据进行合成改进，得到更为有效描述股票特性的数据集；使用包括多因子框架、机器学习和人工智能等多种手段对数据进行二次加工，通过对历史走势的拆解、分析、模拟和优化，从而得到指数成分股的一篮子替代股。

本基金于07月19日开始建仓股票，随后的持股比例维持在83%—90%，区间平均持股比例为87%。进入9月份，市场投资风格转换快速且频繁，这导致基金投资组合经常在调整后的出现变差的效果，基金单位净值在9月份下跌9.64%。自基金成立至三季度末，基金A类单位净值累计下跌8.15%，基金A类单位净值累计下跌8.25%。

鉴于市场投资风格转换过快过频的特点，基金在后期投资过程中将更多关注行业优势和个股价值，降低调仓的节奏，以较长周期关注投资组合的效果。

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0.9185元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.15%，同期业绩比较基准收益率为1.93%；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0.9175元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.25%，同期业绩比较基准收益率为1.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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 | 212,044,248.20 | 88.38 |
| | 其中：股票 | 212,044,248.20 | 88.38 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 5,004,500.00 | 2.09 |
| | 其中：债券 | 5,004,500.00 | 2.09 |
| | 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 | 22,360,608.80 | 9.32 |
| 8 | 其他资产 | 524,127.24 | 0.22 |
| 9 | 合计 | 239,933,484.24 | 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 | 5,778,959.00 | 2.41 |
| B | 采矿业 | 6,616,852.00 | 2.76 |
| C | 制造业 | 132,497,643.22 | 55.32 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,698,229.00 | 2.80 |
| E | 建筑业 | 5,571,109.60 | 2.33 |
| F | 批发和零售业 | 6,612,263.60 | 2.76 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,859,113.00 | 2.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | 654,200.00 | 0.27 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,701,692.00 | 8.23 |
| J | 金融业 | 12,130,223.80 | 5.06 |
| K | 房地产业 | 5,366,163.20 | 2.24 |
| L | 租赁和商务服务业 | 796,111.78 | 0.33 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,572,352.00 | 1.07 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 389,196.00 | 0.16 |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,800,140.00 | 0.75 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 212,044,248.20 | 88.54 |

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 | 600536 | 中国软件 | 141,800 | 7,002,084.00 | 2.92 |
| 2 | 002371 | 北方华创 | 16,200 | 5,924,178.00 | 2.47 |
| 3 | 002384 | 东山精密 | 272,700 | 5,693,976.00 | 2.38 |
| 4 | 000629 | 攀钢钒钛 | 1,164,800 | 5,579,392.00 | 2.33 |
| 5 | 603501 | 韦尔股份 | 21,700 | 5,264,637.00 | 2.20 |
| 6 | 601600 | 中国铝业 | 662,100 | 5,131,275.00 | 2.14 |
| 7 | 000831 | 五矿稀土 | 128,600 | 5,131,140.00 | 2.14 |
| 8 | 002230 | 科大讯飞 | 95,810 | 5,068,349.00 | 2.12 |
| 9 | 002318 | 久立特材 | 340,450 | 4,769,704.50 | 1.99 |
| 10 | 603351 | 威尔药业 | 150,237 | 4,669,365.96 | 1.95 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 5,004,500.00 | 2.09 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|--------------|------|
| 10 | 合计 | 5,004,500.00 | 2.09 |
|----|----|--------------|------|

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019645 | 20国债15 | 50,000 | 5,004,500.00 | 2.09 |

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：本基金本报告期内未投资股指期货。

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的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 | 133,006.23 |
| 5 | 应收申购款 | 391,121.01 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 524,127.24 |

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 |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年07月14日)基金份额总额 | 203,917,145.95 | 40,544,003.58 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 13,402,797.27 | 2,933,013.44 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |

| | | |
|-------------|----------------|---------------|
| 报告期期末基金份额总额 | 217,319,943.22 | 43,477,017.02 |
|-------------|----------------|---------------|

§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

注：本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

§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

2021年10月26日