

瑞达鑫红量化 6 个月持有期混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 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

送出日期:2022 年 08 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。本中期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。

基金托管人华鑫证券有限责任公司根据本基金合同规定，于2022年08月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年06月30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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 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	51
7.7 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	52
7.8 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	52
7.9 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	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 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	54

§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
11.1 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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	100,967,407.66份	
基金合同存续期	不定期	
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	82,889,161.37份	18,078,246.29份

2.2 基金产品说明

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。

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	华鑫证券有限责任公司
信息披露负责人	姓名	胡因
	联系电话	021-53308822
	电子邮箱	kf@ruidaamc.com
客户服务电话	4009958822	021-64339000
传真	021-53391131	021-54967361
注册地址	厦门市思明区槟榔西里197号 第一层448室	深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房
办公地址	上海市浦东新区福山路500号 城建国际中心2508-2510	上海市徐汇区肇嘉浜路750号
邮政编码	200122	200030
法定代表人	李湧	俞洋

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ruidaamc.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期 (2022年01月01日-2022年06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
本期已实现收益	-14,053,323.38	-2,852,943.95
本期利润	-20,690,295.18	-3,951,926.06
加权平均基金份额本期利润	-0.1653	-0.1563
本期加权平均净值利润率	-20.49%	-19.48%
本期基金份额净值增长率	-12.45%	-12.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	-19,037,761.51	-4,217,763.84
期末可供分配基金份额利润	-0.2297	-0.2333
期末基金资产净值	65,976,332.38	14,320,371.84
期末基金份额净值	0.7960	0.7921
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-20.40%	-20.79%

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。

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

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
过去一个月	6.26%	0.87%	5.71%	0.88%	0.55%	-0.01%
过去三个月	1.62%	1.44%	2.00%	1.40%	-0.38%	0.04%
过去六个月	-12.45%	1.45%	-9.38%	1.30%	-3.07%	0.15%
自基金合同 生效起至今	-20.40%	1.32%	-4.75%	1.07%	-15.65%	0.25%

瑞达鑫红量化6个月持有混合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
过去一个月	6.21%	0.87%	5.71%	0.88%	0.50%	-0.01%
过去三个月	1.49%	1.45%	2.00%	1.40%	-0.51%	0.05%
过去六个月	-12.68%	1.45%	-9.38%	1.30%	-3.30%	0.15%
自基金合同 生效起至今	-20.79%	1.32%	-4.75%	1.07%	-16.04%	0.25%

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

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-2022年06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-2022年06月30日)



注：(1) 本基金的合同生效日为 2021 年 07 月 14 日，截止 2022 年 06 月 30 日不满一年。
(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。

§ 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1亿元人民币，为瑞达期货股份有限公司（002961.SZ）100%控股子公司。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06月30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	2021-07-14	-	21	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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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。

4.2 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 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 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

上半年，市场在内外部因素的共同作用下大幅波动，呈现斜“L”型走势。1-2月市场成交额逐步下滑，新基金发行遇冷，海外通胀高企，美债利率大幅上行，科技成长股大幅调整；同时，市场在中央经济工作会议对经济面临三大压力的定调下形成了政策稳增长的一致预期，相关板块表现较好。2月底俄乌战争爆发成为市场预期外的最大变量，叠加国内3月疫情爆发，市场进一步杀跌。尤其在4月疫情超预期恶化，经济修复受阻，市场情绪悲观，表现为股债风险溢价衡量的风险偏好水平处于历史高位。随着4月中下旬疫情见顶，以及美联储加息落地，市场在5-6月持续反弹。行业板块来看，5月汽车、石油石化、电力设备、国防军工领涨；6月电力设备、汽车、食品饮料、有色、家电等领涨，市场演绎从疫后的供给侧修复到需求侧复苏，以汽车、电力设备即新能源为代表的高景气成长赛道是本轮反弹的主线，反弹幅度较大。6月下旬，行情明显开始扩散，一是受地产销售面积环比改善推动的地产链，包括房地产、装饰建材、家电等；二是受防疫政策放松刺激的出行链，包括旅游、酒店、航空等；三是股价下杀幅度较大的医药尤其医疗服务等。但是经济修复并非一蹴而就，同时疫情也有反复，顺周期的板块股价演绎也呈现较大波动。

本基金通过量化的手段对股票进行精选，在风险可控的前提下力争获取超越中证500指数的投资收益。在设计股票组合时，通过量化分析，首先确保一级行业权重基本不变，其次优化各一级行业中三级行业的权重配置，最后精选三级行业中性价比占优的个股构建股票组合，通过每月设计股票组合并实际投资运作实现指数增强目的。基金投资组合注重股票的内在投资价值，投资组合中大盘蓝筹股居多。

4.4.2 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0.7960元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.45%，同期业绩比较基准收益率为-9.38%；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0.7921元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.68%，同期业绩比较基准收益率为-9.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外方面，短期来看，预计美欧等经济体通胀水平仍将维持高位，其经济政策仍以对抗高通胀为主。美联储加息预期已经反映较为充分，7月加息幅度大概率将成为年内加息的高点。目前市场预期9月仍将大概率加息50BP，一方面俄乌冲突制裁给能源价格带来不确定性，服务、房租等价格上冲或导致短期通胀仍存上冲风险，另一方面，虽然美国失业率处于低位、职位空缺率处于高位、产能利用率和个人消费支出也处于相对高位，显示经济仍有一定韧性，短期不会陷入实质性衰退，但美国密歇根消费者信心指数

持续下滑已经处于历史低位，PMI数据也在持续走低，尤其7月Markit服务业PMI从6月的52.7跌至47.0，10Y-2Y美债期限利差转负，大宗商品价格下跌都已经显示出经济衰退的迹象，并且最新的7月28日美国经济分析局发布的数据显示，美国二季度GDP年化环比下跌0.9%，继2022年第一季度下跌1.6%之后连续第二个季度下滑，所以后续加息预期仍将有所波动，未来三次会议的加息路径调整为是50BP、25BP、25BP，2023年一季度可能暂停加息，以评估前期加息的效果。

国内经济仍处于疫后修复中，6月国内经济数据修复明显，一是积压经济活动的释放，二是政策助力以及周期触底后的需求反弹，但是生产端比需求端修复更快，后续修复的持续性还有待继续观察。通胀方面预期对货币政策短期不会形成制约，CPI呈温和向上走势，PPI呈下行趋势。6月社融总量超市场预期，央行近期逆回购也在持续缩量，货币最宽松阶段可能已经过去，但根据7月底政治局会议指明流动性仍将“合理充裕”的表述，以及当前经济修复基础并不牢靠，还有待数据进一步验证，宽松货币政策转向短期可能性不大。

市场经历了大幅反弹，需要获利盘消化调整，预计短期仍呈结构性震荡行情，市场向上需要经济数据再次确认修复，以及相关产业维持高景气来驱动。7-8月市场仍将主要围绕半年报披露展开，预计业绩和下半年展望超预期的个股将有更好的表现。行业方面，下半年是新能源汽车的传统旺季，预计全年销量仍将维持高增长；光伏在下半年硅料产能逐季释放，产业链降价将刺激装机量攀升；其他制造业板块也将受益于PPI-CPI的剪刀差收窄；消费作为慢变量，预计随着经济修复确认，也将迎来结构性反弹。

4.6 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，本基金管理人作为准确、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。会计师事务所对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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金的管理人——瑞达基金管理有限公司在瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对瑞达基金管理有限公司编制和披露的瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金2022年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	983,113.45	12,818,097.79
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	80,007,431.67	228,288,813.41
其中：股票投资		75,931,234.41	220,750,138.41

基金投资		-	-
债券投资		4,076,197.26	7,538,675.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		-	57,285.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	70,023.44
资产总计		80,990,545.12	241,234,220.18
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		498,144.13	-
应付管理人报酬		103,363.99	304,532.62

应付托管费		6,890.94	20,302.18
应付销售服务费		6,098.68	16,831.51
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	6.4.7.6	79,343.16	185,000.00
负债合计		693,840.90	526,666.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	100,967,407.66	264,845,194.34
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-20,670,703.44	-24,137,640.47
净资产合计		80,296,704.22	240,707,553.87
负债和净资产总计		80,990,545.12	241,234,220.18

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额总额100,967,407.66份，其中瑞达鑫红量化6个月持有混合A类基金份额总额为82,889,161.37份，基金份额净值0.7960元；瑞达鑫红量化6个月持有混合C类基金份额总额为18,078,246.29份，基金份额净值0.7921元。

6.2 利润表

会计主体：瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年0 6月30日
一、营业总收入		-23,532,874.81
1. 利息收入		14,154.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,223.46
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		3,931.51
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-15,811,075.87
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-17,782,282.21
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	61,368.01
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,909,838.33
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）	6.4.7.16	-7,735,953.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		1,109,346.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	917,735.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,182.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	51,085.89
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	6.4.7.18	79,343.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,642,221.24
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,642,221.24
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		-24,642,221.24
----------	--	----------------

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30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)	264,845,194. 34	-	-24,137,640. 47	240,707,553. 87
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)	264,845,194. 34	-	-24,137,640. 47	240,707,553. 87
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-163,877,78 6.68	-	3,466,937.03	-160,410,84 9.65
(一)、综合收益总额	-	-	-24,642,221. 24	-24,642,221. 24
(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)	-163,877,78 6.68	-	28,109,158.2 7	-135,768,62 8.41
其中：1. 基金申购款	522,768.52	-	-62,940.93	459,827.59
2. 基金赎回款	-164,400,55 5.20	-	28,172,099.2 0	-136,228,45 6.00
(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）	100,967,407.66	-	-20,670,703.44	80,296,704.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

李湧

王俊晔

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金(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》、《瑞达鑫红量化6个月持有期混合型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[2021]2214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244,461,149.53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(21)第00346号的验资报告。基金合同于2021年7月14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,基金托管人为华鑫证券有限责任公司。

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“瑞达鑫红量化6个月持有混合A”)和C类基金份额(以下简称“瑞达鑫红量化6个月持有混合C”)两类份额。其中,瑞达鑫红量化6个月持有混合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;瑞达鑫红量化6个月持有混合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500指数收益率 \times 80%+上证国债指数收益率 \times 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和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06月30日的财务状况以及自2022年01月01日至2022年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于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。本基金现无金融资产分类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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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在

资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于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。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金

融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第22号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号-金融资产转移》、《企业会计准则第24号-套期会计》和《企业会计准则第37号-金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币0.00元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息，金额分别为人民币12,818,097.79元、人民币0元、人民币0元、人民币0元、人民币70,023.44元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息的金额分别为人民币12,820,932.27元、人民币0元、人民币0元、人民币0元、人民币0元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币228,288,813.41元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币67,846.58元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币228,356,659.99元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类

别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	129,242.62
等于：本金	129,204.94
加：应计利息	37.68
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	853,870.83
等于：本金	853,774.41
加：应计利息	96.42
减：坏账准备	-
合计	983,113.45

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	76,706,944.57	-	75,931,234.41	-775,710.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	75,397.26	4,076,197.26	2,816.88
	银行间市场	-	-	-
	合计	75,397.26	4,076,197.26	2,816.88
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	80,704,927.69	75,397.26	80,007,431.67	-772,893.28

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30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	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	79,343.16

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 瑞达鑫红量化6个月持有混合A**

金额单位：人民币元

项目 (瑞达鑫红量化6个月持有混 合A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	220,875,798.80	220,875,798.80
本期申购	238,134.31	238,134.31
本期赎回(以“-”号填列)	-138,224,771.74	-138,224,771.74
本期末	82,889,161.37	82,889,161.37

6.4.7.7.2 瑞达鑫红量化6个月持有混合C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(瑞达鑫红量化6个月持有混合C)	2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	43,969,395.54	43,969,395.54
本期申购	284,634.21	284,634.21
本期赎回(以“-”号填列)	-26,175,783.46	-26,175,783.46
本期末	18,078,246.29	18,078,246.29

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。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 瑞达鑫红量化6个月持有混合A

单位:人民币元

项目 (瑞达鑫红量化6个月持有混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-25,862,637.65	5,809,871.28	-20,052,766.37
本期利润	-14,053,323.38	-6,636,971.80	-20,690,295.18
本期基金份额交易产生的变动数	20,878,199.52	2,952,033.04	23,830,232.56
其中:基金申购款	-32,010.19	1,351.96	-30,658.23
基金赎回款	20,910,209.71	2,950,681.08	23,860,890.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,037,761.51	2,124,932.52	-16,912,828.99

6.4.7.8.2 瑞达鑫红量化6个月持有混合C

单位:人民币元

项目 (瑞达鑫红量化6个月持有混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-5,238,540.19	1,153,666.09	-4,084,874.10
本期利润	-2,852,943.95	-1,098,982.11	-3,951,926.06
本期基金份额交易产生的变动数	3,873,720.30	405,205.41	4,278,925.71

其中：基金申购款	-36,227.63	3,944.93	-32,282.70
基金赎回款	3,909,947.93	401,260.48	4,311,208.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,217,763.84	459,889.39	-3,757,874.45

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年01月01日至2022年06月30日	
活期存款利息收入		3,650.33
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		6,573.13
结算备付金利息收入		-
其他		-
合计		10,223.46

6.4.7.10 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01月01日至2022年06月30日	
卖出股票成交总额		573,932,123.50
减：卖出股票成本总额		590,768,846.86
减：交易费用		945,558.85
买卖股票差价收入		-17,782,282.21

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年01月01日至2022年06月30日	
债券投资收益——利息收入		57,281.13
债券投资收益——买卖债券（、债转		4,086.88

股及债券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	61,368.01

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,773,442.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,697,126.06
减：应计利息总额	70,640.04
减：交易费用	1,589.46
买卖债券差价收入	4,086.88

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日

股票投资产生的股利收益	1,909,838.33
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	1,909,838.33

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-7,735,953.91
——股票投资	-7,745,634.97
——债券投资	9,681.06
——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	-7,735,953.91

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
合计	79,343.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，新增厦门瑞达恒润投资有限公司为受基金管理人控股股东控制的公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
华鑫证券有限责任公司（“华鑫证券”）	基金托管人、基金销售机构

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华鑫证券	1,026,976,583.38	100.00%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
华鑫证券	7,944,335.73	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华鑫证券	70,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 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01月01日至2022年06月30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
华鑫证券	283,816.50	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)。基金托管人华鑫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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	917,735.03
其中：支付销售机构的客户维护费	455,075.33

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	61,182.35

支付基金托管人华鑫证券的托管费按前一日基金资产净值的0.1%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×0.1%÷当年天数。

6.4.10.2.3 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01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
瑞达基金	0.00	0.21	0.21
华鑫证券	0.00	50,766.02	50,766.02
合计	0.00	50,766.23	50,766.23

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×0.5%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：瑞达鑫红量化6个月持有混合C的日销售服务费=前一日瑞达鑫红量化6个月持有混合C基金资产净值×0.5%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 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**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
华鑫证券	853,774.41	6,573.13

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 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。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301122	采纳股份	2022-01-19	7个月	创业板打新限售	50.31	70.37	155	7,798.05	10,907.35	-
301181	标榜股份	2022-02-11	7个月	创业板打新限售	40.25	30.59	154	6,198.50	4,710.86	-

注：根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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造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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	4,076,197.26	7,538,675.00
合计	4,076,197.26	7,538,675.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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6.4.12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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	983,113.45	-	-	-	983,113.45
交易性 金融资产	4,076,197.26	-	-	75,931,234.41	80,007,431.67
资产总 计	5,059,310.71	-	-	75,931,234.41	80,990,545.12
负债					
应付赎 回款	-	-	-	498,144.13	498,144.13
应付管 理人报 酬	-	-	-	103,363.99	103,363.99
应付托 管费	-	-	-	6,890.94	6,890.94
应付销 售服务 费	-	-	-	6,098.68	6,098.68
其他负 债	-	-	-	79,343.16	79,343.16
负债总 计	-	-	-	693,840.90	693,840.90
利率敏 感度缺	5,059,310.71	-	-	75,237,393.51	80,296,704.22

口					
上年度末 2021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	12,818,097.79	-	-	-	12,818,097.79
交易性金融资产	7,538,675.00	-	-	220,750,138.41	228,288,813.41
应收利息	-	-	-	70,023.44	70,023.44
应收申购款	-	-	-	57,285.54	57,285.54
资产总计	20,356,772.79	-	-	220,877,447.39	241,234,220.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	304,532.62	304,532.62
应付托管费	-	-	-	20,302.18	20,302.18
应付销售服务费	-	-	-	16,831.51	16,831.51
其他负债	-	-	-	185,000.00	185,000.00
负债总计	-	-	-	526,666.31	526,666.31
利率敏感度缺口	20,356,772.79	-	-	220,350,781.08	240,707,553.87

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年06月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为5.08%（2021年12月31日：3.13%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	75,931,234.41	94.56	220,750,138.41	91.71
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	75,931,234.41	94.56	220,750,138.41	91.71

6.4.13.4.3.2 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06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 中证500指数收益率上升5%	3,472,897.88	11,441,795.89
2. 中证500指数收益率下降5%	-3,472,897.88	-11,441,795.89	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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，例如活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；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，例如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值，例如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	75,915,616.20	218,404,129.76
第二层次	4,076,197.26	9,713,091.49
第三层次	15,618.21	171,592.16
合计	80,007,431.67	228,288,813.41

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期内本基金不存在持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	75,931,234.41	93.75
	其中：股票	75,931,234.41	93.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,076,197.26	5.03
	其中：债券	4,076,197.26	5.03
	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	983,113.45	1.21

8	其他各项资产	-	-
9	合计	80,990,545.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	7,123,012.00	8.87
C	制造业	48,130,626.41	59.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	991,025.00	1.23
E	建筑业	1,562,252.00	1.95
F	批发和零售业	2,275,984.00	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	2,566,580.00	3.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,328,857.00	2.90
J	金融业	5,420,000.00	6.75
K	房地产业	3,087,100.00	3.84
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	645,600.00	0.80
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	1,800,198.00	2.24
S	综合	-	-
	合计	75,931,234.41	94.56

7.2.2 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。

7.3 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	601166	兴业银行	220,000	4,378,000.00	5.45
2	600089	特变电工	130,000	3,560,700.00	4.43
3	000063	中兴通讯	123,300	3,147,849.00	3.92
4	600123	兰花科创	190,000	3,125,500.00	3.89
5	601233	桐昆股份	165,000	2,620,200.00	3.26
6	601615	明阳智能	63,600	2,149,680.00	2.68
7	601156	东航物流	100,000	1,980,000.00	2.47
8	002648	卫星化学	70,000	1,809,500.00	2.25
9	600373	中文传媒	180,200	1,800,198.00	2.24
10	601699	潞安环能	121,000	1,769,020.00	2.20
11	601155	新城控股	60,000	1,525,800.00	1.90
12	600985	淮北矿业	103,500	1,506,960.00	1.88
13	000651	格力电器	43,100	1,453,332.00	1.81
14	600438	通威股份	20,900	1,251,074.00	1.56
15	000938	紫光股份	59,100	1,146,540.00	1.43
16	600596	新安股份	50,000	1,082,500.00	1.35
17	688981	中芯国际	23,200	1,047,944.00	1.31
18	600015	华夏银行	200,000	1,042,000.00	1.30
19	000830	鲁西化工	60,000	1,037,400.00	1.29
20	601668	中国建筑	190,900	1,015,588.00	1.26
21	600426	华鲁恒升	34,400	1,004,480.00	1.25
22	600461	洪城环境	122,500	991,025.00	1.23
23	300418	昆仑万维	60,000	960,000.00	1.20
24	002030	达安基因	53,000	911,070.00	1.13
25	600064	南京高科	80,000	880,000.00	1.10
26	002396	星网锐捷	36,000	815,040.00	1.02

27	000960	锡业股份	47,700	799,929.00	1.00
28	603986	兆易创新	5,300	753,713.00	0.94
29	688298	东方生物	6,500	741,975.00	0.92
30	600782	新钢股份	143,500	723,240.00	0.90
31	603071	物产环能	39,300	712,902.00	0.89
32	002110	三钢闽光	116,000	706,440.00	0.88
33	600585	海螺水泥	20,000	705,600.00	0.88
34	600176	中国巨石	39,800	692,918.00	0.86
35	600325	华发股份	90,000	681,300.00	0.85
36	000581	威孚高科	34,900	671,825.00	0.84
37	600475	华光环能	80,000	645,600.00	0.80
38	600884	杉杉股份	21,200	630,064.00	0.78
39	002008	大族激光	19,000	629,470.00	0.78
40	002415	海康威视	17,000	615,400.00	0.77
41	002240	盛新锂能	9,900	597,564.00	0.74
42	601919	中远海控	42,200	586,580.00	0.73
43	002315	焦点科技	41,300	579,026.00	0.72
44	600566	济川药业	21,100	573,076.00	0.71
45	600141	兴发集团	12,900	567,471.00	0.71
46	000039	中集集团	39,200	542,920.00	0.68
47	000933	神火股份	40,000	523,200.00	0.65
48	002759	天际股份	19,000	516,420.00	0.64
49	600888	新疆众和	53,000	487,600.00	0.61
50	600801	华新水泥	24,500	477,995.00	0.60
51	000988	华工科技	20,000	463,400.00	0.58
52	000932	华菱钢铁	90,500	460,645.00	0.57
53	600755	厦门国贸	61,200	459,000.00	0.57
54	000672	上峰水泥	28,500	449,730.00	0.56
55	600273	嘉化能源	41,200	447,432.00	0.56
56	688068	热景生物	6,000	446,280.00	0.56
57	002236	大华股份	27,000	443,340.00	0.55

58	300782	卓胜微	3,200	432,000.00	0.54
59	002346	柘中股份	32,000	416,000.00	0.52
60	603501	韦尔股份	2,400	415,272.00	0.52
61	600507	方大特钢	58,900	411,711.00	0.51
62	603589	口子窖	6,900	404,409.00	0.50
63	002601	龙佰集团	20,000	401,000.00	0.50
64	002202	金风科技	26,200	387,760.00	0.48
65	002978	安宁股份	10,000	386,300.00	0.48
66	603416	信捷电气	9,300	382,602.00	0.48
67	600295	鄂尔多斯	20,580	371,469.00	0.46
68	603508	思维列控	27,580	369,296.20	0.46
69	300482	万孚生物	8,300	337,893.00	0.42
70	600711	盛屯矿业	43,200	335,232.00	0.42
71	600332	白云山	10,400	328,536.00	0.41
72	000661	长春高新	1,400	326,788.00	0.41
73	300037	新宙邦	6,000	315,360.00	0.39
74	600096	云天化	10,000	314,800.00	0.39
75	002737	葵花药业	20,100	314,364.00	0.39
76	603369	今世缘	6,100	311,100.00	0.39
77	300401	花园生物	17,500	303,450.00	0.38
78	002466	天齐锂业	2,400	299,520.00	0.37
79	002649	博彦科技	28,600	292,006.00	0.36
80	000049	德赛电池	6,400	288,640.00	0.36
81	601186	中国铁建	35,700	282,030.00	0.35
82	601390	中国中铁	43,100	264,634.00	0.33
83	300390	天华超净	3,000	262,200.00	0.33
84	300463	迈克生物	12,700	260,223.00	0.32
85	600392	盛和资源	11,400	257,640.00	0.32
86	000683	远兴能源	24,300	255,393.00	0.32
87	300122	智飞生物	2,300	255,323.00	0.32
88	300571	平治信息	6,100	251,930.00	0.31

89	603989	艾华集团	8,800	248,160.00	0.31
90	600075	新疆天业	38,800	247,932.00	0.31
91	300770	新媒股份	6,500	245,895.00	0.31
92	601607	上海医药	13,500	244,080.00	0.30
93	600511	国药股份	8,600	230,308.00	0.29
94	002876	三利谱	5,600	224,112.00	0.28
95	002637	赞宇科技	14,600	220,752.00	0.27
96	603368	柳药集团	12,700	218,694.00	0.27
97	000028	国药一致	7,000	208,530.00	0.26
98	600998	九州通	17,000	202,470.00	0.25
99	600580	卧龙电驱	13,000	187,460.00	0.23
100	000636	风华高科	9,400	176,626.00	0.22
101	688181	八亿时空	4,000	173,200.00	0.22
102	688819	天能股份	5,000	172,900.00	0.22
103	600183	生益科技	9,900	168,201.00	0.21
104	600380	健康元	13,600	167,960.00	0.21
105	301122	采纳股份	155	10,907.35	0.01
106	301181	标榜股份	154	4,710.86	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	13,980,109.00	5.81
2	601318	中国平安	13,024,008.88	5.41
3	601166	兴业银行	12,535,753.00	5.21
4	000063	中兴通讯	9,182,675.00	3.81
5	600015	华夏银行	9,136,094.00	3.80
6	601233	桐昆股份	7,968,209.00	3.31
7	601601	中国太保	7,498,824.00	3.12

8	600919	江苏银行	7,370,876.00	3.06
9	601336	新华保险	6,302,726.00	2.62
10	002648	卫星化学	5,794,928.00	2.41
11	601328	交通银行	5,462,172.00	2.27
12	000938	紫光股份	4,775,818.17	1.98
13	000977	浪潮信息	4,471,959.00	1.86
14	600596	新安股份	4,353,139.00	1.81
15	600373	中文传媒	4,195,074.00	1.74
16	002179	中航光电	4,181,663.00	1.74
17	002396	星网锐捷	4,140,176.00	1.72
18	600123	兰花科创	4,078,553.20	1.69
19	688298	东方生物	3,933,073.10	1.63
20	601688	华泰证券	3,873,131.00	1.61

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	14,224,429.84	5.91
2	601318	中国平安	12,804,109.00	5.32
3	601166	兴业银行	8,281,865.30	3.44
4	600015	华夏银行	7,818,679.00	3.25
5	600919	江苏银行	7,458,458.00	3.10
6	601601	中国太保	6,972,500.00	2.90
7	601336	新华保险	6,079,874.40	2.53
8	000063	中兴通讯	5,483,961.00	2.28
9	601328	交通银行	5,399,824.00	2.24
10	600587	新华医疗	4,961,927.29	2.06
11	601233	桐昆股份	4,892,281.00	2.03
12	000977	浪潮信息	4,394,851.00	1.83

13	002443	金洲管道	4,200,845.00	1.75
14	002648	卫星化学	4,116,394.21	1.71
15	002179	中航光电	4,100,915.00	1.70
16	600303	ST曙光	3,749,681.65	1.56
17	601688	华泰证券	3,730,588.00	1.55
18	000999	华润三九	3,669,634.00	1.52
19	000938	紫光股份	3,529,585.00	1.47
20	600837	海通证券	3,526,013.03	1.46

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。

7.4.3 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	453,695,577.83
卖出股票收入（成交）总额	573,932,123.50

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,076,197.26	5.08
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	4,076,197.26	5.08

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019658	21国债10	40,000	4,076,197.26	5.08

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

注：其他各项资产期末无余额。

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
瑞达鑫红量化6个月持有混合A	1,300	63,760.89	2,982,214.94	3.60%	79,906,946.43	96.40%
瑞达鑫红量化6个月持有混合C	380	47,574.33	108.99	0.00%	18,078,137.30	100.00%
合计	1,680	60,099.65	2,982,323.93	2.95%	97,985,083.73	97.05%

8.2 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	占基金总份额
----	------	--------	--------

		(份)	比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	瑞达鑫红量化6个月持有混合A	23.31	0.00%
	瑞达鑫红量化6个月持有混合C	10.00	0.00%
	合计	33.31	0.00%

注：（1）期末基金管理人所有从业人员持有瑞达鑫红量化6个月持有混合A的总份额占基金总份额比例为：0.000028%；

（2）期末基金管理人所有从业人员持有瑞达鑫红量化6个月持有混合C的总份额占基金总份额比例为：0.000055%；

（3）期末基金管理人所有从业人员持有瑞达鑫红量化6个月持有混合的总份额占基金总份额比例为：0.000033%；

（4）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）。

8.3 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	瑞达鑫红量化6个月持有混合A	0
	瑞达鑫红量化6个月持有混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	瑞达鑫红量化6个月持有混合A	0
	瑞达鑫红量化6个月持有混合C	0
	合计	0

§ 9 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
本报告期期初基金份额总额	220,875,798.80	43,969,395.54
本报告期基金总申购份额	238,134.31	284,634.21
减:本报告期基金总赎回份额	138,224,771.74	26,175,783.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	82,889,161.37	18,078,246.29

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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，继续代任公司督察长职务，由公司董事长李湧先生代任总经理职务。

2、基金管理人于2022年4月26日公告，聘任胡囡女士为公司副总经理兼代任督察长，夏萌先生不再代任督察长。

3、2022年6月17日，经总经理办公会扩大会议2022年第四次会议审议，同意任命宋娴文女士为上海分公司负责人。

4、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、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，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，未发生托管人及其相关高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
华鑫证券有限责任公司	4	1,026,976,583.38	100.00%	283,816.50	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。

10.7.2 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
华鑫证券有限责任公司	7,944,335.73	100.00%	70,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 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	瑞达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	瑞达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息的公告	上海证券报、证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-12
3	关于瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-13
4	瑞达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海万得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-14
5	关于瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金恢复大额申购及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-15
6	瑞达基金管理有限公司关于旗下部分基金网下获配首次公开发行股票的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
7	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	上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2022-01-22
8	瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金2021年第4季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-22
9	瑞达基金管理有限公司关于旗下基金增加诺亚正行基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-11

10	瑞达基金管理有限公司关于旗下部分基金网下获配首次公开发行股票的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-15
11	瑞达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海攀赢基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-28
12	瑞达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海联泰基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-28
13	瑞达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2022-03-31
14	瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金2021年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-31
15	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、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-08
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	上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2022-04-22
17	瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金2022年第1季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
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、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-26
19	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及产品资料概要更新的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-02

20	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（更新）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-02
21	瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金（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	2022-06-02
22	瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金（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	2022-06-02

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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、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
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 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

12.3 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
二〇二二年八月三十一日