

# 万家共赢中泰量化 30FOF 均衡 5 号集合资产管理计划

## 2024 年第 2 季度报告

万家共赢资产管理有限公司作为万家共赢中泰量化 30FOF 均衡 5 号集合资产管理计划（以下简称“资产管理计划”或“本计划”）的资产管理人，特就报告期内资产管理计划的运作情况出具本报告。

### 一、重要提示

1. 资产管理人不保证本计划财产不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。资产管理人及/或本计划的过往业绩并不代表其未来表现，资产管理人及/或其他产品的业绩并不代表本计划业绩，本计划份额不是资产管理人的负债。本报告内容仅供投资者参考，不构成资产管理人保证投资本金不受损失或取得最低收益的承诺。

2. 本报告的报告期为自 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

3. 资产管理人依据公开渠道、投资标的等相关方提供及其他渠道获得本报告中的财务资料及数据的相关信息，该等财务资料和数据等信息未经审计，资产管理人不对该等信息的真实性、准确性及完整性作独立验证，仅供投资者参考。

4. 本报告所披露的资产管理计划投资状态及/或目前情况系资产管理人根据上述渠道获得的信息整理描述，存在资产管理人对投资标的价值信息获取不完全、投资标的风险状况、监管规定要求的估值方法的变动及其他原因导致本报告中财务资料及数据等信息不能完全反映本计划财产实际价值的情况。

5. 本计划的运作等情况均不能代表投资者退出本计划时的实际情况。资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用计划财产所产生的风险，由本计划财产及投资者承担。

6. 本报告仅供投资者了解本计划信息之用，本报告内容均涉及商业秘密，未经资产管理人书面同意，不得擅自向任何第三人披露，其他方不得援引本报告之任何内容用于司法或任何其他用途，他用无效。

7. 本报告任何内容不应被视为向投资者提供任何建议或保证，也不构成资产管理人的任何保证。本报告在法律法规允许的范围内由资产管理人负责解释。

## 二、资产管理计划概况

资产管理计划简称	万家共赢量化 30 均衡 5 号
资产管理计划代码	SNS988
资产管理计划类型	集合资产管理计划
资产管理计划运作方式	开放式
资产管理计划成立日期	2021 年 5 月 31 日
存续期限	120 个月
资产管理人	万家共赢资产管理有限公司
资产托管人	中泰证券股份有限公司
是否分级	否

## 三、资产管理计划投资表现

主要财务指标	2024 年第 2 季度
本期已实现收益（元）	41,599.33
本期利润（元）	32,559.43
报告期末资产净值（元）	4,994,110.95
报告期末计划份额净值（元）	0.9837
报告期末计划份额总额（份）	5,076,891.00

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
2024 年第 2 季度	0.60%	0.23%	不适用	不适用	不适用	不适用

## 四、资产管理计划投资收益分配情况

指标	2024 年第 2 季度
资产管理计划收益分配情况（元）	0.00

## 五、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

### (一) 投资经理变更情况

姓名	任职日期	离任/变更日期	简介
张鹏	2021年5月31日	2022年6月23日	复旦大学经济学硕士, FRM, 长期从事金融工程研究和量化投资工作, 历任信诚基金量化投资部副总监、万家基金量化投资部副总监兼基金经理、财通证券资产管理有限公司量化投资总监。2019年9月加入万家共赢资产管理有限公司, 任投资经理、组合基金管理部总监, 现已离职。
傅一特	2022年6月23日	-	金融学硕士, CFA, 从事大类资产配置研究、权益类资产研究。2017年12月加入万家共赢资产管理有限公司, 历任万家共赢资产管理有限公司证券投资部研究员、投资经理助理, 2022年2月起任投资经理。
姚霞天	2022年6月23日	2024年3月22日	复旦大学金融硕士, 具备基金从业资格, 多年投资研究经验, 历任泰信基金管理有限公司数量分析师、万家基金管理有限公司风险与绩效分析师、量化分析师、专户投资经理, 申港证券股份有限公司投资经理、上海珠池资产管理有限公司高级投资经理等, 2022年5月加入万家共赢资产管理有限公司, 曾任组合基金管理部副总监、投资经理, 现已离职。

唐科	2024年3月 22日	-	西南财经大学学士、硕士，多年证券基金从业经验。历任华福证券投资管理总部投资经理、北京朗志资产投资总监、江海证券证券投资部高级研究员、万和证券场外市场部投资管理岗。2023年9月加入万家共赢资产管理有限公司，现任组合基金管理部总监助理、投资经理。
----	----------------	---	--

(二) 重大关联交易事项

无。

(三) 其他涉及投资者权益的重大事项

无。

## 六、管理人履职报告

本计划根据资产管理合同及相关约定进行投资活动。报告期内，未发现影响资产管理计划运作的重大风险事件。

考虑到投资中的实际需要，在不改变产品风险收益特征预期的前提下，产品管理人有权根据市场情况随时调整具体资产配置比例。

## 七、托管人履职报告

报告期内，本托管人严格遵守法律法规、自律规则的规定以及资产管理合同的约定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害份额持有人利益的行为。

报告期内，本托管人按照法律法规、自律规则的规定以及资产管理合同的约定，对本资产管理计划净值计算、利润分配等方面进行了复核；对本资产管理计划投资运作方面进行了监督，未发现管理人存在不符合资产管理合同约定的托管人投资监督事项的情况。

基于管理人提供的必要估值要素，托管人仅以目前取得的资料发表意见。托管人认为由管理人或其委托的外包服务机构编制并经托管人复核的本资产管理

计划 2024 年第二季度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等财务信息真实、准确和完整。

## 八、资产管理计划的费用

### 1. 管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的应支付的管理费	13,084.78

本计划的年管理费率为【1.00】%，计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div 365$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的计划资产净值

其中，本计划成立当日应计提的管理费=本计划成立日当日初始委托财产本金×年管理费率÷365

管理费自本计划成立日（含）起，每日计提，于每个开放日（含临时开放日，含当日）起的 5 个工作日内管理人向托管人发送划款指令，托管人收到划款指令后对管理费金额进行复核并支付。若遇不可抗力或头寸不足致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。若计划提前终止，则在计划终止日或清算日计提管理费时一次性补足。除另有约定，若本计划展期或延期的，延期或展期期间继续计提和支付管理费。

### 2. 托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的应支付的托管费	261.71

本计划的年托管费率为【0.02】%，计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划资产净值

其中，本计划成立当日应计提的托管费=本计划成立日当日初始委托财产

本金×年托管费率÷365

托管费自本计划成立日（含）起，每日计提，于每个开放日（含临时开放日，含当日）起的5个工作日内管理人向托管人发送划款指令，托管人收到划款指令后对托管费金额进行复核并支付。若遇不可抗力或头寸不足致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。若计划提前终止，则在计划终止日或清算日计提托管费时一次性补足。除另有约定，若本计划展期或延期的，延期或展期期间继续计提和支付托管费。

### 3.外包服务费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年4月1日至2024年6月30日
当期发生的应支付的外包服务费	261.71

本计划的年外包服务费率【0.02】%，计算方法如下：

$$H=E\times\text{年外包服务费率}\div 365$$

H为每日应计提的外包服务费

E为前一日的计划资产净值

其中，本计划成立当日应计提的外包服务费=本计划成立日当日初始委托财产本金×年外包服务费率÷365

外包服务费自本计划成立日（含）起，每日计提，于每个开放日（含临时开放日，含当日）起的5个工作日内管理人向托管人发送划款指令，托管人收到划款指令后对外包服务费金额进行复核并支付。若遇不可抗力或头寸不足致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。若计划提前终止，则在计划终止日或清算日计提外包服务费时一次性补足。除另有约定，若本计划展期或延期的，延期或展期期间继续计提和支付外包服务费。

## 九、资产管理计划投资组合报告

序号	投资标的	期末持仓金额（元）
1	量派对冲9号A类	1,015,996.31
2	正瀛骐骥7号私募证券投资基金	1,020,261.63
3	托特市场中性2号A	1,012,505.22

4	汉盛浩远 1 号私募证券投资基金	907,690.13
5	同温层量化阿尔法 1 号 B	1,026,835.90

万家共赢资产管理有限公司

2024 年 7 月 25 日