

附件5:

量化交易情况表

序号	机构名称	机构P码	基金名称	产品S码	基金净资产规模(万元)	单位净值(元)	基金成立日	基金到期日	募集方式	是否托管	投资者人数(其中:自然人数量)	量化交易情况					结构化和分级情况		基金合同约定预警线(元)	基金合同约定止损线(元)	备注		
												是否开展量化交易	策略类型					基金名称中含有“量化”字段				是否分级	分级杠杆比例
													指数增强	中性策略	量化多头						
1	示例				30,650.83	1.002	2020/1/1	2025/1/1	请选择...	请选择...	30 (20)												
2																							
...																							
合计																							

说明:
 1、本表的填写口径为存续的量化私募基金,包括实际不是量化基金但基金名称中有“量化”字段的,基金名称填写全称;
 2、如一只基金存在多种策略类型的,可多选,策略类型不属于上表列示类型的,可在“其他”列自行补充;
 3、分级杠杆比例=优先级份额/劣后级份额,结构化产品若存在中间级份额,应当在计算杠杆倍数时计入优先级份额;
 4、数据截至2024年6月30日。