

前海开源小确幸5号集合资产管理计划

2022年第3季度报告

2022年09月30日

资产管理人:前海开源基金管理有限公司

资产托管人:上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行

§ 1 管理人履职报告

一、 总述

在本报告期内本资产管理计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证投资于本资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

二、 报告期内资产管理计划的投资策略和运作分析

本计划通过多策略结合以赚取稳定的超额收益，通过定量和定性相结合的方式精选基金及底层个券赚取 alpha 收益。风险控制方面采用股指期货对冲权益风险，使组合整体风险控制在合同规定的范围内。

组合 2022 年第三季度收益率 0.09%，其中策略 Alpha 贡献 1.07%，净多头以及基差分别贡献-0.62%和-0.22%。

组合三季度操作层面上，策略配置上变动不大，主要对策略其中的基金进行了优化并小幅调整了仓位。截至 20220930，组合在策略配置上为固收+基金策略占比约 93%，其中固收+打新策略基金占比约 49%，稳健型二级债策略基金占比约 44%，净权益敞口约 2%。

展望未来，我们对权益市场观点中性，大概率不会出现单边牛市或单边熊市的情况，稳增长以及中国经济转型等因素依然有利于寻找到结构性的投资机会。后续将根据宏观经济形势、市场情况、股指期货的基差走势等动态调整组合净权益敞口。同时我们将继续维持多策略并行的方式以获取多元 Alpha，并持续开发能带来相对稳定超额收益的新策略，力争为投资者带来较为稳健的收益。

§ 2 托管人履职报告

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行（以下简称“托管人”）在前海开源小确幸 5 号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同的规定，不存在损害资产份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了资产托管人应尽的义务。

本报告期内，托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法

律法规、资产管理合同的规定，对前海开源小确幸5号集合资产管理计划的投资运作进行了监督，对资产管理计划资产净值的计算、资产管理计划份额申购赎回价格的计算以及资产管理计划费用开支等方面进行了认真的复核，未发现资产管理人存在损害资产份额持有人利益的行为。

本报告期内，由前海开源基金管理有限公司编制托管人复核的本报告中的资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告的内容真实、准确、完整。

§ 3 资产管理计划投资表现

1、资产管理计划产品概况

资产管理计划全称	前海开源小确幸5号集合资产管理计划
资产管理计划编码	448637
资产管理计划合同生效日	2022年01月19日
报告期末资产管理计划份额总额	6,305,971.73份
资产管理人	前海开源基金管理有限公司
资产托管人	上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行

2、主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
本期已实现收益	46,545.73
本期利润	18,457.61
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0022
期末资产管理计划资产净值	6,266,156.80
期末资产管理计划份额净值	0.9937

3、资产管理计划净值表现

阶段	净值增长率
过去三个月	0.09%

§ 4 资产管理计划投资组合报告

4.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总
----	----	-------	----------

			资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	5,819,041.39	92.59
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	328,211.78	5.22
8	其他资产	137,340.00	2.19
9	合计	6,284,593.17	100.00

4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

4.3 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

无。

4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

4.5 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

4.6 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

4.7 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

4.8 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

4.9 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名基金明细

序号	名称	类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	易方达稳健收益债券B	开放式基金	契约型开放式	易方达基金管理有限公司	1,299,778.03	20.74
2	前海开源泽鑫混合C	开放式基金	契约型开放式	前海开源基金管理有限公司	1,291,760.46	20.61
3	前海开源嘉鑫混合C	开放式基金	契约型开放式	前海开源基金管理有限公司	1,280,796.51	20.44
4	鹏华双债增利债券	开放式基金	契约型开放式	鹏华基金管理有限公司	980,293.08	15.64
5	前海开源裕和混合C	开放式基金	契约型开放式	前海开源基金管理有限公司	474,085.74	7.57

4.10 报告期末本资产管理计划投资的股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2212	沪深300股指期货2212合约	-1	-1,144,500.00	67,200.00	-
公允价值变动总额合计(元)					67,200.00

股指期货投资本期收益（元）	12,540.61
股指期货投资本期公允价值变动（元）	174,060.00

4.11 报告期末本资产管理计划投资的国债期货交易情况说明

无。

§ 5 资产管理计划投资收益分配情况

无

§ 6 投资经理及变更

6.1 资产管理计划投资经理简介

姓名	证券从业年限	说明
童芄骏	3年	通信技术和金融计算理学双硕士，2018年加入前海开源基金，历任量化分析员、基金研究员，主要负责全市场基金产品的研究工作。对选基、选股相关策略均有研究和实盘经验。现任前海开源基金管理有限公司金融工程部投资经理。

6.2 报告期内资产管理计划投资经理变更

无

§ 7 资产管理计划运用杠杆情况

本资产管理计划在本报告期间未使用杠杆进行投资。

§ 8 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

8.1 资产管理人的管理费

本资产管理计划的管理费按前一日资产管理计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

本资产管理计划的年管理费率为 0.5%

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年实际天数}$

H为每日应计提的管理费

E为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划管理费自资产管理合同生效之日起，每日计提，按季支付。每个季度结束后5个工作日内资产管理人向资产托管人发送委托财产管理费划付指令，资产托管人复核后从资产管理计划资产中一次性支付给资产管理人。

8.2 资产托管人的托管费

委托财产的年托管费率为【0.03】%，计算方法和支付时间如下：

托管费按前一日委托财产净值的0.03%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年实际天数}$$

H为每日应计提的托管费

E为前一日委托财产净值

托管费自资产管理合同生效之日起，每日计提，按季支付。每个季度结束后5个工作日内资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人收到划款指令后对托管费金额进行复核，并从委托财产中一次性支付给资产托管人。

托管费接收账户信息如下：

户名：基金公司特定客户资产托管业务收入

开户行：浦发银行深圳分行

账号：79010142110000105

大额支付号：310584000006

委托人、管理人、托管人确认：资产管理合同约定的托管费、账户管理费、托管人汇划费收费标准经三方协商确定，三方均认可该收费标准。

8.3 资产管理人的业绩报酬

1) 业绩报酬的计提原则

①业绩报酬的收取时间：本计划计提业绩报酬的基准日为计划发生退出或终止时（以下简称“计提基准日”）；注册登记机构在计划退出确认日、终止日依据计划计提基准日的份额净值计算业绩报酬。

②业绩报酬的计算基础：业绩报酬以资产管理计划退出或终止时财产的投资增值部分（净值增长部分）高于预先设定的业绩报酬计提基准的部分为基础进行计算；

③业绩报酬的计算区间：原则上根据资产管理计划份额的持有期限分别计算业绩报酬。

2) 业绩报酬的计算公式

业绩报酬比率为 10%，具体计算公式如下：

② 当 $E_n \leq B$ 时，业绩报酬=0。

②当 $E_n > B$ ，业绩报酬= $(E_n - B) \times 10\%$ ，

其中，

E_n 为资产委托人计划退出或终止时所持有份额在该期间的收益。计算方法为： $E_n = S_i \times (NAV1 + D - NAV0)$

B 为按照资产管理计划业绩报酬计提基准（年化）计算的计划退出或终止时所持有份额在该期间的业绩报酬提取基准，其计算方法为： $B = S_i \times NAV0 \times R \times T_i / 365$

上述公式中，

S_i 为资产委托人计划退出或终止时所持有的份额，若该笔份额由不同持有期的份额构成，则将按照持有期拆分计算。

$NAV0$ 为资产委托人计划退出或终止时所持有份额所对应的不同持有期份额所对应的认购或参与价格。

$NAV1$ 为资产委托人计划退出或终止时适用的计划份额净值。

T_i 为资产委托人计划退出或终止时所持有某笔资产的份额自合同生效日起始或某笔资产参与本资产管理计划参与确认日起始的持有天数(含退出日)。

D 为资产委托人计划退出或终止时所持有某笔资产的份额自合同生效日起始或某笔资产参与本资产管理计划参与确认日起始的累计单位分红(含退出日)。

R 为资产管理计划业绩报酬计提基准，年化收益率 6.8%。

资产管理计划应计提的总业绩报酬由注册登记机构负责计算，资产管理人向资产托管人发送划款指令，由资产托管人从资产管理计划清算财产中一次性支付给资产管理人。

业绩报酬收取信息如下：

名称：前海开源基金管理有限公司

账号：755919496410107

开户行：招商银行股份有限公司深圳滨河时代支行

§ 9 重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

本资产管理计划在本报告期末持有管理人前海开源基金管理有限公司管理的证券投资基金：前海开源泽鑫混合 C、前海开源嘉鑫混合 C、前海开源裕和混合 C。本资产管理计划主要通过场内公允价格购买或场外遵循“未知价”原则购买，交易价格公允，不存在损害委托财产及委托人利益的情形或利益冲突。以上关联交易属于资产管理合同明确允许的交易类型，合法合规。

§ 10 其他事项

无。

前海开源基金管理有限公司
2022年10月28日