

野村东方国际 CTA 旗舰 1 号 FOF 集合资产管理计划

2021 年第 3 季度报告

资产管理人:野村东方国际证券有限公司

资产托管人:宁波银行股份有限公司

报告期间:2021 年 07 月 01 日-2021 年 09 月 30 日

目录

§1 重要提示.....	3
§2 资产管理计划产品概况.....	3
§3 主要财务指标和资产管理计划净值表现.....	3
3.1 主要财务指标.....	3
3.2 自资产管理计划合同生效以来资产管理计划累计净值增长率变动.....	3
§4 管理人报告.....	4
4.1 投资经理（或投资经理小组）简介.....	4
4.2 报告期内资产管理计划的投资报告.....	4
4.3 报告期内本资产管理计划运作遵规守信情况说明.....	5
4.4 报告期内资产管理计划投资收益分配情况.....	5
4.5 产品运用杠杆情况.....	5
§5 投资组合报告.....	5
5.1 报告期末资产管理计划资产组合情况.....	5
5.2 报告期末本资产管理计划投资的股指期货交易情况说明.....	6
5.3 报告期末本资产管理计划投资的国债期货交易情况说明.....	6
§6 资产管理计划支付的费用计提基准、计提方式和支付方式.....	6
6.1 固定管理费.....	6
6.2 托管费.....	6
§7 资产管理计划份额变动.....	6
§8 重大事项揭示.....	7
8.1 投资经理变更情况.....	7
8.2 重大关联交易情况.....	7
8.3 证券期货经营机构董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与证券期货经营机构设立的集合资产管理计划.....	7
8.4 其他涉及投资者利益的重大事项.....	7

§ 1 重要提示

本报告由野村东方国际CTA旗舰1号FOF集合资产管理计划（以下称“资产管理计划”）管理人野村东方国际证券有限公司（以下称“野村东方国际”）编制，本资产管理计划托管人已复核本报告中的主要财务指标、净值表现、投资组合报告、财务会计报告、收益分配情况等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本资产管理计划资产，但不保证本资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

本报告期自2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	CTA旗舰1号FOF
资产管理计划编码	PFF006
资产管理计划运作方式	契约型开放式
资产管理计划合同生效日	2021年05月11日
报告期末资产管理计划份额总额	30,526,740.75份
资产管理计划合同存续期	10年
资产管理人	野村东方国际证券有限公司
资产托管人	宁波银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

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01日 - 2021年09月30日）
本期已实现收益	-111,535.14
本期利润	1,368,236.42
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0475
期末资产管理计划资产净值	31,747,201.49
期末资产管理计划份额净值	1.0400

3.2 自资产管理计划合同生效以来资产管理计划累计净值增长率变动

野村东方国际CTA旗舰1号FOF集合资产管理计划累计净值增长率走势图

(2021年05月11日-2021年09月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

姓名	职务	任本资产管理计划的投资经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李丹	投资经理	2021-05-11	-	8	北京大学财政学硕士，北京大学生物医学英语学士、经济学双学士，近10年金融产品设计和研究经验，历任前海厚朴科技股权投资管理（深圳）有限公司高级投资经理、中国国际金融股份有限公司财富服务中心投资经理。

4.2 报告期内资产管理计划的投资报告

本资产管理计划报告期内上涨4.79%。报告期内，国内南华商品综合指数整体上涨6.08%。细分板块上，能化板块涨幅居前（27.61%）其中原油、燃油、LPG液化石油气分别涨7.38%、12.30%和33.30%。黑色板块涨10.19%，其中煤炭系的焦煤、焦炭、动力煤分别涨

96.47%、51.93%和97.82%。农产品板块涨9.23%，其中棕榈油、红枣、棉花分别涨34.04%、33.87%和22.66%。有色金属涨3.91%，其中锡、铝分别涨29.40%和20.26%。贵金属跌6.47%，其中黄金跌1.28%，白银跌14.17%。

报告期内，管理人基本维持了对于精选的底层基金的配置，受益于商品市场整体相对流畅的趋势行情，组合内基金均实现了不同幅度的上涨，为组合带来了较为可观的收益。

展望四季度，我们认为主要工业品的供需矛盾或将延续，对CTA策略可能仍较为有利，但没有人可以准确的预测未来市场环境的变化，对于投资者而言，短期择时是较为困难的，最好的投资方法是以长期的视角配置优质的资产或策略。

4.3 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

本报告期内，资产管理计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他法律法规的规定，本着诚实守信、谨慎勤勉的原则管理和运用本资产管理计划资产，在严格控制风险的基础上，为本资产管理计划持有人谋求最大利益。本资产管理计划运作合法合规，无损害本资产管理计划持有人利益的行为，本资产管理计划的投资管理符合有关法规的规定。

4.4 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

报告期内，本资产管理计划未进行收益分配。

4.5 产品运用杠杆情况

本报告期末杠杆率为100.26%，报告期内杠杆率控制符合资产管理计划的约定。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	-	-
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	1,619,194.08	5.09
8	其他资产	30,209,482.90	94.91
	其中：私募基金	29,809,460.50	93.66
9	合计	31,828,676.98	100.00

5.2 报告期末本资产管理计划投资的股指期货交易情况说明

5.2.1 报告期末本资产管理计划投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末未持有股指期货。

5.3 报告期末本资产管理计划投资的国债期货交易情况说明

5.3.1 报告期末本资产管理计划投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末未持有国债期货。

§ 6 资产管理计划支付的费用计提基准、计提方式和支付方式

6.1 固定管理费

计提基准	费率为1.00%/年。
计提方式	$H = E \times 1.00\% \div 365$ H为每日应计提的固定管理费 E为前一日的资产管理计划财产净值 固定管理费首日计提时，以本资产管理计划成立时的资产管理计划规模为计提基准。
支付方式	按每年 365日，每日计提，按季支付。

6.2 托管费

计提基准	费率为0.01%/年。
计提方式	$H = E \times 0.01\% \div 365$ H为每日应计提的托管费 E为前一日的资产管理计划财产净值 托管费首日计提时，以本资产管理计划成立时的资产管理计划规模为计提基准。
支付方式	按每年365日，每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付。

§ 7 资产管理计划份额变动

单位：份

报告期期初资产管理计划份额总额	28,693,648.62
报告期期间资产管理计划总申购份额	1,833,092.13

减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	-
报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末资产管理计划份额总额	30,526,740.75

§ 8 重大事项揭示

8.1 投资经理变更情况

本报告期内，无投资经理变更事项。

8.2 重大关联交易情况

本报告期内，无重大关联交易。

8.3 证券期货经营机构董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与证券期货经营机构设立的集合资产管理计划

截至报告期末，本公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本资产管理计划共3,600,261.00份。本公司自有资金参与本资产管理计划2,000,000.00份。

8.4 其他涉及投资者利益的重大事项

本报告期内，无其他涉及投资者利益的重大事项。



野村东方国际证券有限公司
2021年10月29日