

野村东方国际 CTA 旗舰 1 号 FOF 集合资产管理计划

2021 年第 4 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 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 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合规守信情况说明.....	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本资产管理计划情况.....	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10月01日起至2021年12月31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	PPF006
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	27,209,814.22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10月01日 - 2021年12月31日）
本期已实现收益	-64,377.79
本期利润	-678,370.07
加权平均资产管理计划份额本期利润	-0.0222
期末资产管理计划资产净值	27,696,792.04
期末资产管理计划份额净值	1.0179

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12月31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下跌2.13%。报告期内，国内南华商品综合指数整体下跌1.62%。细分板块上，农产品板块涨5.10%，其中苹果、生猪、棕榈油分别涨16.68%、14.53%和10.41%。有色金属板块涨4.74%，其中锡、镍、锌分别涨16.36%、11.99%和7.69%。贵金属

板块涨3.44%，其中黄金涨2.97%，白银涨4.05%。能化板块跌12.55%，其中原油涨1.85%，燃油、LPG液化石油气分别跌2.22%和21.02%。黑色板块跌14.86%，其中煤炭系的焦炭、焦煤、动力煤分别跌14.90%、28.29%和41.67%。

报告期内，管理人基本维持了对于精选的底层基金的配置，增加了中短周期CTA持仓。受商品市场整体震荡下行，以及黑色系商品在政策调控之后出现的价格大幅回调影响，组合内基金多数发生回撤。

展望2022年一季度，我们认为在国家稳增长的宏观政策定调下，主要工业品需求或将受到提振，CTA策略可能从中受益。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 115.76%，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	1,965,939.53	6.13
8	其他资产	30,095,505.40	93.87
9	合计	32,061,444.93	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	30,526,740.75
报告期期间资产管理计划总申购份额	887,836.64

减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	4,204,763.17
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	27,209,814.22

§ 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本资产管理计划情况

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3,100,040.50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
2022年01月28日