

野村东方国际 CTA 旗舰 1 号 FOF 集合资产管理计划
2021 年年度报告



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 05 月 11 日-2021 年 12 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

本报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告期自2021年05月11日起至2021年12月31日止。

1.2 目录	
§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 资产管理计划产品概况	4
§3 主要财务指标、资产管理计划净值表现及利润分配情况	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
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	4
§4 管理人报告	5
4.1 投资经理（或投资经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本资产管理计划运作遵守守信情况的说明	5
4.3 报告期内资产管理计划的投资报告	6
4.4 报告期内资产管理计划投资收益分配情况	6
4.5 产品运用杠杆情况	6
4.6 资产管理计划支付的费用的计提基准、计提方式和支付方式	6
§5 投资组合报告	7
5.1 期末资产管理计划资产组合情况	7
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	7
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	7
§6 年度财务报表	7
6.1 资产负债表	7
6.2 利润表	9
6.3 所有者权益（资产管理计划净值）变动表	10
§7 资产管理计划份额变动	10
§8 重大事项揭示	11
8.1 投资经理变更情况	11
8.2 重大关联交易情况	11
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	11
8.4 其他涉及投资者利益的重大事项	11

§ 2 资产管理计划产品概况

2.1 资产管理计划基本情况

资产管理计划名称	野村东方国际CTA旗舰1号FOF集合资产管理计划
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
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

§ 3 主要财务指标、资产管理计划净值表现及利润分配情况

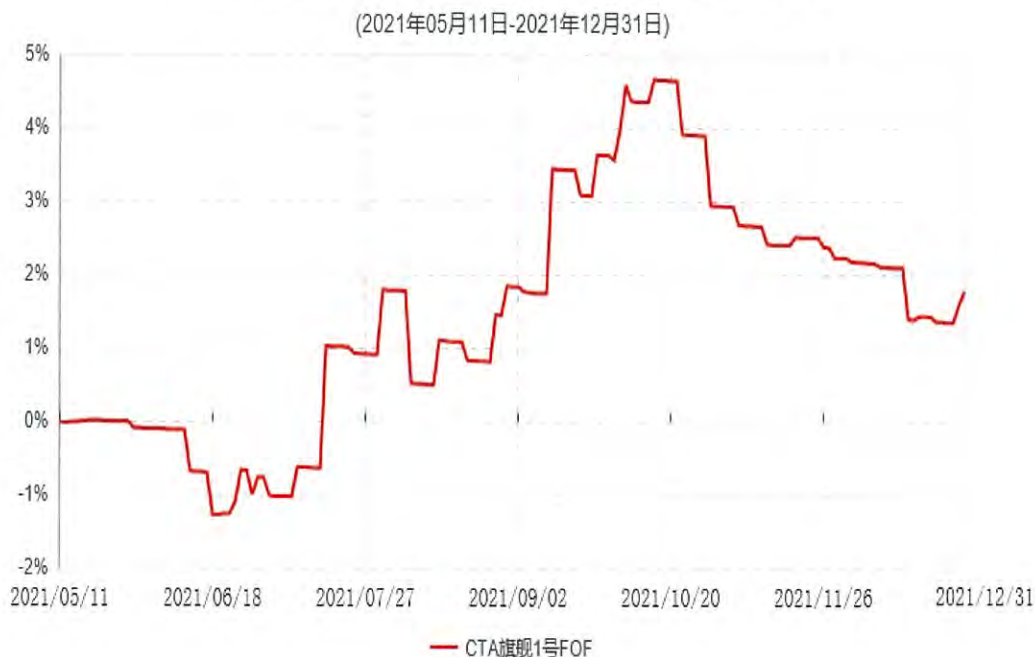
3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期间数据和指标	本期2021年05月11日（资产管理计划合同生效日）- 2021年12月31日
本期已实现收益	-189,715.25
本期利润	505,752.97
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0175
本期加权平均净值利润率	1.73%
本期资产管理计划份额净值增长率	1.79%
期末数据和指标	2021年末
期末可供分配利润	-177,517.95
期末可供分配资产管理计划份额利润	-0.0065
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
累计期末指标	2021年末
资产管理计划份额累计净值增长率	1.79%

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



§ 4 管理人报告

4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

4.1.1 投资经理（或投资经理小组）及投资经理助理简介

姓名	职务	任本资产管理计划的投资经理（助理）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 管理人对报告期内本资产管理计划运作合规守信情况的说明

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，本着诚实信用、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。

4.3 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1.79%。报告期内，国内南华商品综合指数整体上涨0.16%。细分板块上，农产品板块涨10.56%，其中苹果、棕榈油分别涨35.70%和34.52%，生猪跌39.79%。能化板块涨10.17%，其中LPG液化石油、原油、燃油分别涨25.35%、17.55%和14.69%。有色金属板块涨2.77%，其中锡、镍、锌分别涨65.64%、18.02%和5.86%。贵金属板块跌8.67%，其中黄金跌2.77%，白银跌17.69%。黑色板块跌17.28%，其中焦煤、焦炭分别涨32.87%和15.29%，铁矿石跌43.70%。

受商品市场整体震荡以及黑色系品种在政策调控之后出现的价格大幅回调影响，组合内基金在四季度多数发生回撤，但自成立以来绝大多数基金都取得了绝对正收益。

展望2022年，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，其作为一类优质的另类资产，与股市和债市相关性均较低，是非常值得长期配置的优质策略。我们对本资产管理计划的长期表现充满信心。

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。

4.6 资产管理计划支付的费用计提基准、计提方式和支付方式

4.6.1 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。

4.6.2 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。

§ 5 投资组合报告

5.1 期末资产管理计划资产组合情况

金额单位：人民币元

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	理财产品投资	30,095,468.22	93.87
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	其他各项资产	37.18	-
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

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

本报告期末未持有国债期货

§ 6 年度财务报表

6.1 资产负债表

会计主体：野村东方国际CTA旗舰1号FOF集合资产管理计划

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2021年12月31日
资 产：	
银行存款	1,965,939.53
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
理财产品投资	30,095,468.22
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	37.18
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	32,061,444.93
负债和所有者权益	本期末 2021年12月31日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	4,272,039.38
应付管理人报酬	79,221.28
应付托管费	792.23
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-

应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	12,600.00
负债合计	4,364,652.89
所有者权益：	
实收资产	27,209,814.22
未分配利润	486,977.82
所有者权益合计	27,696,792.04
负债和所有者权益总计	32,061,444.93

6.2 利润表

会计主体：野村东方国际CTA旗舰1号FOF集合资产管理计划

本报告期：2021年05月11日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2021年05月11日（资产管理计划合同生效日）至2021年12月31日
一、收入	712,092.68
1. 利息收入	1,974.34
其中：存款利息收入	1,974.34
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	14,650.12
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
理财产品投资收益	-9,937.98
衍生工具收益	-
股利收益	24,588.10
投资收益_差价收入增值税抵减	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	695,468.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、费用	206,339.71
1. 管理人报酬	189,054.70

2. 托管费	1,890.60
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	2,794.41
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	12,600.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	505,752.97
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	505,752.97

6.3 所有者权益（资产管理计划净值）变动表

会计主体：野村东方国际CTA旗舰1号FOF集合资产管理计划

本报告期：2021年05月11日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年05月11日（资产管理计划合同生效日）至2021年1 2月31日		
	实收资产	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（资产管理计划净值）	25,863,078.45	-	25,863,078.45
二、本期经营活动产生的资产管理计划净值变动数（本期利润）	-	505,752.97	505,752.97
三、本期资产管理计划份额交易产生的资产管理计划净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,346,735.77	-18,775.15	1,327,960.62
其中：1. 资产管理计划参与款	5,551,498.94	48,501.06	5,600,000.00
2. 资产管理计划退出款	-4,204,763.17	-67,276.21	-4,272,039.38
四、本期向资产管理计划份额持有人分配利润产生的资产管理计划净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（资产管理计划净值）	27,209,814.22	486,977.82	27,696,792.04

§ 7 资产管理计划份额变动

单位：份

资产管理计划合同生效日(2021年05月11日)资产管理计划份额总额	25,863,078.45
资产管理计划合同生效日起至报告期期末资产管理计划总参与份额	5,551,498.94
减:资产管理计划合同生效日起至报告期期末资产管理计划总退出份额	4,204,763.17
资产管理计划合同生效日起至报告期期末资产管理计划拆分变动份额	-
本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。



