

野村东方国际宜鸿1号FOF集合资产管理计划

2024年第2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:2024年04月01日-2024年06月30日



§1 重要提示

本报告由野村东方国际宜鸿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2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	宜鸿1号FOF
资产管理计划编码	PFF005
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04月14日
报告期末资产管理计划份额总额	3,781,708.74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（2024年04月01日 - 2024年06月30日）
本期已实现收益	11,268.14
本期利润	3,431.17
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0008
期末资产管理计划资产净值	2,731,743.69
期末资产管理计划份额净值	0.7224

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

野村东方国际宜鸿1号FOF集合资产管理计划累计净值增长率走势图
(2021年04月14日-2024年06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		
邓希	投资经理	2023-10-27	-	10年	英国华威商学院（WBS）金融数学硕士、英国华威大学数学与经济学士。历任财通证券资产管理有限公司量化投资经理、投资经理助理，财通证券股份有限公司资产管理部投研助理。2019年加入野村东方国际证券。
魏沁蕊	投资经理	2024-05-27	-	7年	金融数学硕士，FRM。10年以上投资研究经验，曾就职于法国兴业银行（纽约），波士顿咨询公司（纽约）负责衍生品交易以及投研等工作，历任光大证券资产管理有限公司账户经理、光大保德信基金管理有限公司量化对冲投顾经理、光大保德信资产管理有限公司投资经理、蚂蚁集团金融分析专家。

4.2 报告期内资产管理计划的投资报告

报告期内，国内各主要指数方面，上证综合指数-2.43%、沪深300指数-2.14%、中证500指数-6.50%、中证1000指数-10.02%，中债总指数+1.75%，南华商品指数+4.49%。

综合大类资产的表现看：首先，国内A股方面，二季度以来持续横盘震荡，期间高股息板块显著受到投资者青睐；第二，国内十年期国债收益率最低下行至2.2%，虽然央行屡次提示投资长债的风险，但市场买盘依旧汹涌；第三，商品市场波动放大，前期市场一度将宏观预期计入交易主线，但进入二季度，受整体需求疲弱影响，商品价格或逐步回归产业基本面；第四，美元指数仍位于105中枢一带，人民币汇率徘徊在7.25-7.3一带，美元强势并人民币贬值压力犹存。

展望三季度，从权益、固收、商品三大资产维度看，权益市场需特别关注二十届三中全会的政策颁布，预计后续大概率仍有利好政策出台，在新一轮的政策刺激下，更多增量资金或有望回归A股，利好后续股票市场向上趋势形成。固收市场方面，当前国内资本市场主要资金均投资于债券、货币市场基金等低风险理财产品，因当前宏观经济走弱、地缘冲突等因素叠加，极大程度影响了居民的风险偏好，下一阶段居民存款或进一步向固收类低风险理财产品转移，国内利率下行趋势或进一步扩大。商品市场方面，当前市场投资主线主要聚焦于贵金属、有色及新能源方面，其中海外通胀预期并产能大量投放不减，使得有色及新能源板块有望持续受到资金青睐。此外，在当前国际地缘冲突并美联储降息预期的大背景下，以黄金为代表的贵金属商品，或仍有较高的配置价值。

4.3 报告期内本资产管理计划运作遵规守信情况说明

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。

4.4 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100.51%，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	2,707,501.05	98.61
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	31,593.99	1.15
8	其他资产	6,625.01	0.24
9	合计	2,745,720.05	100.00

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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 管理费

计提基准	费率为1.00%/年。
计提方式	每日计提，每年按365日计
支付方式	按季支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每季初的第五个交易日内按照指定的账户路径进行资金支付

6.2 托管费

计提基准	费率为0.01%/年。
计提方式	每日计提，每年按365日计
支付方式	按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每个自然季初的第五个交易日按照指定的账户路径进行资金支付

6.3 业绩报酬

计提基准	(1) 本计划的业绩报酬计提基准为8%（年化）； (2) 本计划业绩报酬计提比例为资产管理计划份额的期间收益超过同期业绩报酬计提基准部分的15%。
计提方式	管理人就每笔业绩报酬计算期间对资产管理计划份额收益进行收益率的测算，若该笔份额取得的经单利年化后的收益率超过业绩报酬计提基准，则超出的部分经折算回业绩报酬计算期间的期间收益率，基于资产管理

	计划份额在上一个业绩报酬计提日的净值按照业绩报酬计提比例计算出该笔资产管理计划份额应计提的业绩报酬。
支付方式	对于符合业绩报酬提取原则的部分，管理人于业绩报酬计算期之后的5个工作日内向托管人发送业绩报酬支付指令，托管人依据指令从资产管理计划财产中一次性支付给管理人。

§ 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	4,281,194.06
报告期期间资产管理计划总申购份额	-
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	499,485.32
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	3,781,708.74

§ 8 其它事项揭示

8.1 投资经理变更情况

本报告期投资经理任职和离职情况详见本报告4.1章节。

8.2 关联交易情况

本报告期内，无重大关联交易。

本报告期内，发生一般关联交易如下：

关联方报酬：

	报告期间计提金额（元）	报告期间支付金额（元）
管理费	7,541.91	7,720.01
托管费	75.36	77.21
业绩报酬	-	-

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资产管理计划的情况

截至报告期末，无本公司董事、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。无本公司自有资金参与本资产管理计划。

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
2024年07月30日

宁波银行股份有限公司 托管报告

本报告期内（2024年二季度），本托管人在野村东方国际宜鸿1号FOF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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、资产管理合同和其他有关规定，不存在损害委托人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内（2024年二季度），本托管人按照国家有关规定、资产管理合同和其他有关规定，对委托资产净值计算、费用开支等方面进行了认真的复核，对委托资产的投资运作方面进行了监督，未发现损害委托人利益的行为。

在我行能够知悉和掌握的情况范围内，在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下，本托管人复核了《野村东方国际宜鸿1号FOF集合资产管理计划2024年第2季度报告》中的财务指标、财务会计报告、投资组合报告等财务信息，确保上述数据准确、完整。



宁波银行股份有限公司
二〇二四年七月二十九日