

野村东方国际均衡价值1号集合资产管理计划

2024年第1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:南京银行股份有限公司

报告期间:2024年01月01日-2024年03月31日



§ 1 重要提示

本报告由野村东方国际均衡价值1号集合资产管理计划（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01月01日起至2024年03月31日止。

§ 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	均衡价值1号
资产管理计划编码	PE9008
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	2023年08月22日
报告期末资产管理计划份额总额	10,000,945.00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	南京银行股份有限公司

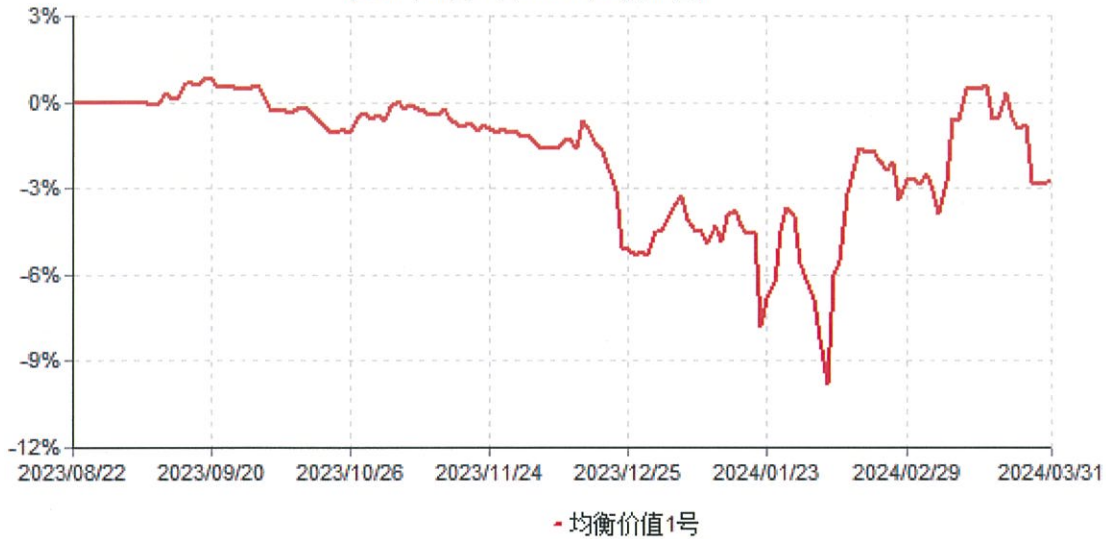
§ 3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

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01月01日 - 2024年03月31日）
本期已实现收益	-53,318.27
本期利润	167,287.84
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0167
期末资产管理计划资产净值	9,719,510.33
期末资产管理计划份额净值	0.9719

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

野村东方国际均衡价值1号集合资产管理计划累计净值增长率走势图
(2023年08月22日-2024年03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		
何智超	投资经理	2023-08-22	-	7年	北京大学计算机技术硕士,超过7年股票市场监管工作经历。曾任东北证券研究所分析师,财通证券资产管理有限公司权益分析师。

4.2 报告期内资产管理计划的投资报告

从一季度总体情况来看,尽管短期经济动能仍偏弱,但仍有一些结构性亮点:1)金融数据方面,M1增速止跌释放偏积极的信号。2)进出口数据方面,出口增速高于预期,新动能支撑延续。3)通胀数据方面,CPI底部回升,核心CPI继续走平,而PPI降幅收窄。

其次,近期市场微观资金面也在边际改善。1)近期海外对中国资产的态度或有所改观,外资也基本结束了前期的单边流出。2)从ETF流入数据来看,已有资金开始底部布局A股优质资产。

随着积极变化不断涌现,当前市场在底部有望迎来修复。更重要的是,若后续经济企稳回升,更多结构性的亮点出现,那么届时市场有望转向景气投资范式。

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109.08%，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	6,765,246.00	63.81
	其中：股票	6,765,246.00	63.81
2	基金投资	976,517.10	9.21
3	固定收益投资	1,191,074.30	11.23
	其中：债券	1,191,074.30	11.23
	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	812,120.66	7.66
8	其他资产	856,831.82	8.08
9	合计	10,601,789.88	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

交易目的：本计划投资股指期货的主要目的是回避市场风险和实施套利策略。符合既定的投资目的。

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）
-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）				-

股指期货投资本期收益（元）	-2.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-

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%/年
计提方式	每日计提，按每年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0.02%/年
计提方式	每日计提，按每年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内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6%（年化）；（2）本计划业绩报酬计提比例为委托财产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	管理人就每笔委托财产业绩报酬计算期间对该笔委托财产投资收益进行收益率的测算，若该笔委托财产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，基于该笔委托财产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委托财产应计提的业绩报酬。
支付方式	业绩报酬由管理人计算，托管人不承担复核义务，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，本合同另有约定的，从其约定。

§ 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	10,000,945.00
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	-
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	10,000,945.00

§ 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	24,109.06	24,927.74
托管费	482.17	498.48
业绩报酬	-	-
佣金	18,871.62	8,296.20

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，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 6,600,297.00份。本公司自有资金参与本资产管理计划 400,018.00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

2024年04月29日

关于野村东方国际证券 2024 年第一季度报告托管复核意见函

野村东方国际证券有限公司：

本托管人对我行托管的野村东方国际证券有限公司的《野村东方国际均衡价值 1 号集合资产管理计划》产品 2024 年第一季度报告已收悉。根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》，我部对贵公司编制的资产管理计划 2024 年第一季度报告内容中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，所复核的内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。



南京银行资产托管部

2024年4月24日