

野村东方国际均衡价值 1 号集合资产管理计划 2023 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:南京银行股份有限公司

报告期间:2023 年 08 月 22 日-2023 年 12 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2023年08月22日起至2023年12月31日止。

§ 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	野村东方国际均衡价值1号集合资产管理计划
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
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

§ 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

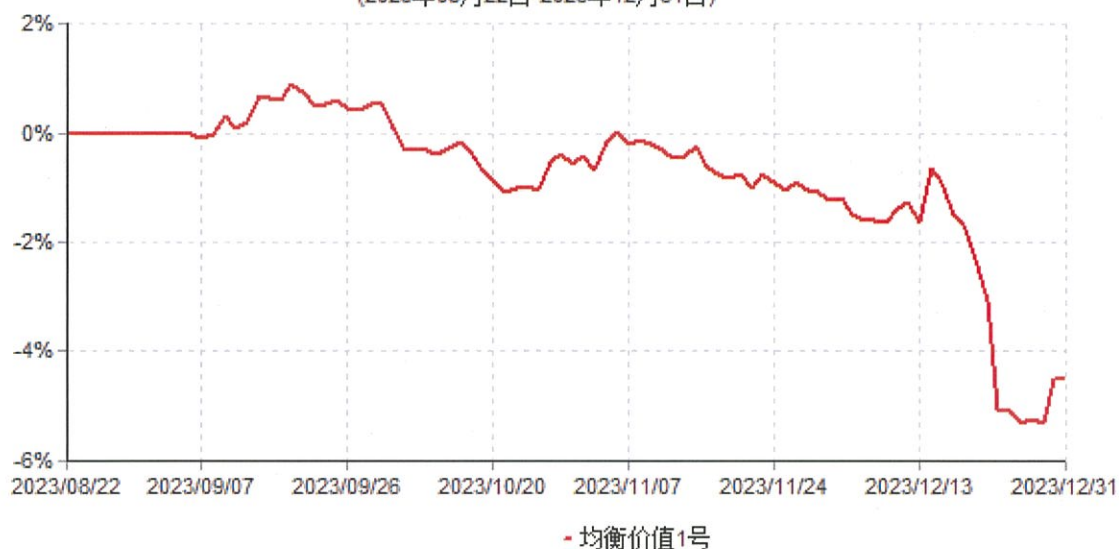
金额单位：人民币元

期间数据和指标	本期
	2023年08月22日（资产管理计划合同生效日） - 2023年12月31日
本期已实现收益	-132,059.21
本期利润	-448,722.51
加权平均资产管理计划份额本期利润	-0.0449
本期加权平均净值利润率	-4.52%
本期资产管理计划份额净值增长率	-4.49%
期末数据和指标	2023年末
期末可供分配利润	-448,722.51

期末可供分配资产管理计划份额利润	-0.0449
期末资产管理计划资产净值	9,552,222.49
期末资产管理计划份额净值	0.9551
累计期末指标	2023年末
资产管理计划份额累计净值增长率	-4.49%

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-2023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

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		
何智超	投资经理	2023-08-22	-	6年	北京大学计算机技术硕士，超过6年股票市场研究工作经历。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 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

4.3.1 报告期内资产管理计划的投资报告

2023年指数整体承压，上证相对小幅回落，创业板回落明显。截至12月31日收盘，2023年主要指数中，上证指数下跌3.7%，沪深300指数下跌11.4%，深证成指下跌13.5%，创业板下降13.5%，上证50指数下跌11.7%。行业方面，通信、传媒、计算机等板块领涨，涨幅分别是25.7%、16.8%、9.0%；商贸零售、房地产、电力设备等板块下跌，跌幅分别是-31.3%、-26.4%、-26.2%。

尽管短期经济动能仍偏弱，但仍存在一些结构性亮点：1) 金融数据方面，2023年12月新增社融1.94万亿元，同比多增6169亿元，M1增速止跌也释放积极信号。2) 进出口数据方面，出口增速高于市场预期，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编辑改善；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流入角度看，已有资金积极布局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。本组合将继续贯彻价值投资理念，以定价为核心方法，积极寻找投资机会。

4.3.2 报告期内资产管理计划的投资表现

报告期间，本资产管理计划净值年度增长率为-4.49%。

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101.99%，报告期内杠杆率控制符合资产管理计划的约定。

§ 5 资产管理计划支付的费用计提基准、计提方式和支付方式

5.1 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按照指定的账户路径进行资金支付

5.2 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按照指定的账户路径进行资金支付

5.3 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。

§ 6 投资组合报告

6.1 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	占资产管理计划总资产的比例(%)
1	权益投资	3,300,354.00	33.88
	其中：股票	3,300,354.00	33.88
2	基金投资	1,742,216.30	17.88
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	4,373,715.75	44.90
8	其他各项资产	325,559.89	3.34

9	合计	9,741,845.94	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。

6.2 报告期末本资产管理计划投资的股指期货交易情况说明

6.2.1 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。

6.3 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。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：野村东方国际均衡价值1号集合资产管理计划

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	期末余额 2023年12月31日
资 产：	
货币资金	4,366,774.67
结算备付金	6,941.08
存出保证金	5,239.19
衍生金融资产	-
应收清算款	320,320.70
应收利息	-
应收股利	-
应收申购款	-
买入返售金融资产	-
发放贷款和垫款	-
交易性金融资产	5,042,570.30
债权投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
长期股权投资	-
其他资产	-
资产总计	9,741,845.94
负债和净资产	期末余额 2023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	-
应付管理人报酬	24,927.74
应付托管费	498.48
应付销售服务费	-
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付清算款	143,301.03
应付赎回款	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	20,896.20
负债合计	189,623.45
净资产：	
实收资金	10,000,945.00
其他综合收益	-
未分配利润	-448,722.51
净资产合计	9,552,222.49
负债和净资产总计	9,741,845.94

7.2 利润表

会计主体：野村东方国际均衡价值1号集合资产管理计划

本报告期：2023年08月22日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期金额
	2023年08月22日(资产管理计划合同生效日)至2023年12月31日
一、营业总收入	-399,029.87
利息收入	3,424.32
投资收益(损失以“-”填列)	-85,790.89
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-316,663.30
汇兑损益(损失以“-”填列)	-
其他业务收入	-
二、营业总支出	49,692.64

管理人报酬	35,914.54
其中：暂估管理人报酬	-
托管费	718.26
销售服务费	-
投资顾问费	-
利息支出	-
信用减值损失	-
税金及附加	59.84
其他费用	13,000.00
三、利润总额	-448,722.51
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-448,722.51
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	-448,722.51

7.3 净资产变动表

会计主体：野村东方国际均衡价值1号集合资产管理计划

本报告期：2023年08月22日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期金额 2023年08月22日（资产管理计划合同生效日）至2023年12月31日			
	实收资金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末余额	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初余额	10,000,945.00	-	-	10,000,945.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-448,722.51	-448,722.51
（一）综合收益总额	-	-	-448,722.51	-448,722.51
（二）产品持有人申购和赎回	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-
（三）利润分配	-	-	-	-
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末余额	10,000,945.00	-	-448,722.51	9,552,222.49

§ 8 资产管理计划份额变动

单位：份

资产管理计划合同生效日(2023年08月22日)资产管理计划份额总额	10,000,945.00
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	-
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	-
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	-
本报告期末资产管理计划份额总额	10,000,945.00

§ 9 其他事项揭示

9.1 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。

9.2 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	35,914.54	10,986.80
托管费	718.26	219.78
业绩报酬	-	-
佣金	10,322.19	2,025.99

9.3 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。

9.4 其他涉及投资者利益的重大事项

无。

野村东方国际证券有限公司
二〇二四年四月二十二日

关于野村东方国际证券 2023 年年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下列产品 2023 年年度报告已收悉。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 2023 年年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 04 月 18 日

野村东方国际丰和 18 号集合资产管理计划	野村东方国际丰和 8 号集合资产管理计划
野村东方国际双季赢 2 号集合资产管理计划	野村东方国际丰和 10 号集合资产管理计划
野村东方国际均衡价值 1 号集合资产管理计划	野村东方国际丰和 6 号集合资产管理计划
野村东方国际丰和 15 号集合资产管理计划	野村东方国际丰和 9 号集合资产管理计划
野村东方国际丰和 12 号集合资产管理计划	野村东方国际丰和 1 号集合资产管理计划
野村东方国际祺和 1 号集合资产管理计划	