

野村东方国际宜和1号FOF集合资产管理计划

2023年第3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:2023年07月01日-2023年09月30日



§ 1 重要提示

本报告由野村东方国际宜和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2023年07月01日起至2023年09月30日止。

§ 2 资产管理计划产品概况

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 资产管理计划简称 | 宜和1号FOF | |
| 资产管理计划编码 | PFF003 | |
| 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02月08日 | |
| 报告期末资产管理计划份额总额 | 8,329,756.96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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 野村东方国际宜和1号FO FA | 野村东方国际宜和1号FO FC |
| 下属分级基金的交易代码 | PFF003 | PFF004 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,866,426.05份 | 5,463,330.91份 |

§ 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(2023年07月01日 - 2023年09月30日) | |
|------------------|--------------------------------|--------------------|
| | 野村东方国际宜和1号FO FA | 野村东方国际宜和1号FO FC |
| 本期已实现收益 | -98,501.43 | -167,802.10 |
| 本期利润 | -193,931.63 | -303,595.39 |
| 加权平均资产管理计划份额本期利润 | -0.0517 | -0.0521 |
| 期末资产管理计划资产净值 | 2,542,852.10 | 4,846,557.39 |
| 期末资产管理计划份额净值 | 0.8871 | 0.8871 |

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

野村东方国际宜和1号FOFA累计净值增长率走势图

(2021年02月08日-2023年09月30日)



野村东方国际宜和1号FOFC累计净值增长率走势图

(2021年02月08日-2023年09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 | 证 券 | 说明 |
|----|----|--------------|--------|----|
| | | | | |

| | | 理期限 | | 从业年限 | |
|----|------|------------|------------|------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐玮 | 投资经理 | 2022-12-30 | - | 7年 | 中国人民大学金融硕士，武汉大学经济学学士。曾任职于中国国际金融股份有限公司财富服务中心，2019年加入野村东方国际证券有限公司，拥有特许金融分析师（CFA）资格。 |
| 李丹 | 投资经理 | 2021-02-08 | 2023-08-30 | 10年 | 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，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 5.56%，同期沪深 300、中证 500、中证 1000 指数分别下跌 3.98%、5.13%和 7.92%，中债总指数上涨 0.62%。

报告期内，A 股市场整体下行。行业方面，31 个申万一级行业指数仅 8 个收正，其中电力设备、传媒、计算机跌幅较大，煤炭、非银金融、建筑建材涨幅相对靠前。虽然国内基建、消费出行改善贡献一定积极因素，但整体经济仍然面临复苏向上弹性不足等多重压力，令市场整体表现偏弱。债券市场方面，央行于 9 月完成 25BP 的降准操作落地，年内已完成两次降准+两次降息操作，货币政策流动性合理宽松态势延续，对债市形成一定支撑。海外宏观方面，美国十年期国债收益率从 3.8580%一路涨至 4.5790%，美元指数从 103.38 升至 106.13，布伦特原油主力合约从 75.19 飙升至 93.13，期间市场还经历联储超预期的鹰派表态，对国内汇率及股票市场造成负面扰动。

展望四季度，鉴于对国内经济基本面托底的需要，我们认为各项政策或进入集中发力期，叠加近期中东地缘政治局势并美联储加息预期降温等海外因素，中美关系有望得到进一步缓和，对股市形成利好。但需要注意的是，国内地产行业销售仍未企稳，基本面复苏动能不足，并海外依然处于金融条件收紧周期，均不支持股票市场形成大级别的全面行情启动，四季度或更多以结构性机会为主。债市方面，虽然依旧面临汇率承压及经济超预期反弹等因素制约，但当前国内宽松的货币政策+温和通胀环境+地方债化债举措陆续出台显示偿债意愿坚挺，整体合力偏积极，四季度债市整体下行风险有限。

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100.37%，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投资组合情况

| 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 | 7,309,075.15 | 98.55 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 理财产品投资 | - | - |
| 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 | 97,518.38 | 1.31 |
| 8 | 其他资产 | 10,098.78 | 0.14 |
| 9 | 合计 | 7,416,692.31 | 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0.8%/年。 |
| 计提方式 | 每日计提，每年按365日计 |
| 支付方式 | 按自然季度支付，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工作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 | 10,029,774.96 |
| 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 | 1,700,018.00 |
| 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 | 8,329,756.96 |

§ 8 其他事项揭示

8.1 投资经理变更情况

自2023年8月30日起，李丹女士不再担任本资产管理计划的投资经理，即调整后本资产管理计划的投资经理为徐玮先生。

8.2 关联交易情况

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 | 17,638.40 | 20,068.60 |
| 托管费 | 220.46 | 250.88 |
| 业绩报酬 | - | - |
| 佣金 | 31.36 | 31.36 |

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

2023年10月30日