

金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划 2023年度报告

计划管理人：金元证券股份有限公司

计划托管人：中国光大银行股份有限公司北京分行

报告期间：2023年1月1日-2023年12月31日

重要提示

本报告依据《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》及其他有关规定制作。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人已于2024年4月24日复核了本报告。

本报告已经审计。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告起止时间：2023年1月1日-2023年12月31日

目录

一、集合计划产品概况.....	4
二、主要财务指标.....	5
三、集合计划管理人报告.....	7
四、集合计划托管人报告.....	9
五、审计报告.....	10
六、集合计划财务报告.....	13
七、集合计划投资组合报告（2023 年 12 月 31 日）.....	25
八、重要事项提示.....	26
九、关联方关系.....	28
十、备查文件目录.....	38

一、集合计划产品概况

名称：金元鑫灏1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2019年9月17日

报告期末计划总份额：5,456,285.08份

存续期：到期日为2027年9月16日

投资目标：本集合计划以股票、衍生品及债券为主要投资标的，以大类资产配置为核心理念，以获取绝对收益为投资目标，对大类资产择机择时进行动态配置，以高评级信用债券及期权套利获取稳定收益，以自下而上的精选股票标的获取弹性收益，通过宏观经济和微观市场分析全面灵活捕捉市场机会，在风险分散可控的前提下获得净值的稳健增长。

投资范围：（1）固定收益类投资品种：包括但不限于在银行间/交易所发行或上市交易的国债、企业债券、地方政府债、政府机构债、资产支持证券、公司债券（含非公开发行公司债）、可转换债券、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会和发改委批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、超短期融资券、中期票据、项目收益债、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、债券逆回购、同业存单等；

（2）权益类投资品种：包括但不限于境内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、科创板标的股票（含新股申购、二级市场买入）；

（3）货币市场工具：包括但不限于银行存款（含通知存款、协议存款和同业存款）等；

（4）金融产品：包括公募证券投资基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的产品；

(5) 金融衍生品类资产：股指期货、国债期货以及证券交易所发行上市的股票期权；

(6) 债券正回购等中国证监会认可的其他品种。

托管人：中国光大银行股份有限公司北京分行

信息披露网址：www.jyzq.cn

二、主要财务指标

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期间（2023年1月1日-2023年12月31日）
本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	-192,101.66
本期利润	-125,153.70
其中：本期公允价值变动损益	66,947.96
本期单位净值增长率	-5.6825%
期末可分配利润	-456,973.60
期末可供分配份额利润	-0.0838
期末资产净值	4,999,311.48
期末单位资产净值	0.9162
单位累计净值增长率	5.0949%

(二) 财务指标计算公式

1、单位集合计划资产净值=集合计划资产净值÷集合计划份额

2、本期单位集合计划净值增长率=（本期第一次分红前单位集合计划资产净值÷期初单位集合计划资产净值）×（本期第二次分红前单位集合计划资产净值÷本期第一次分红后单位集合计划资产净值）×……×（期末单位集合计划资产净值÷本期最后一次分红后单位集合计划资产净值）-1

3、单位集合计划累计净值增长率=（第一年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（第二年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（第三年度单位集合计划资产净值增长率+1）×……×（上年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（本期单位集合计划资产净值增长率+1）-1

（三）集合计划累计净值增长率变动情况

1、本计划历史各时间段净值增长率列表

阶段	净值增长率
过去三个月	-4.1832%
过去一年	-5.6825%
本计划成立至本报告期末	5.0949%

注：本计划成立日为2019年9月17日。

2、本计划累计单位净值历史走势图



（四）集合计划收益分配情况

本集合计划2023年未进行收益分配。

三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

本集合计划于2019年9月17日成立，截至2023年12月31日，集合计划单位净值为0.9162元，累计单位净值为1.0636元。

（二）投资经理简介

陈勇先生，全日制本科学历，毕业于海南大学旅游企业管理专业，14年证券从业经验，《海南资本市场》通讯员，曾为《海南日报》、《海口晚报》经济版特约财经评论员；海南广电《第一财经》、《海南电视台综合频道》证券、财经评论特约嘉宾。操作风格稳健又不失犀利，大势前瞻敏感，热点题材敏锐，对宏观经济、新科技、泛消费行业有深入研究。

杨宜霏女士，中山大学经济学学士，EMBA，在读管理学博士。曾任职于头部通信运营商数据和互联网部、大型私募基金等机构，2009年至今在金元资管从事管理和研究等工作，具备丰富的数字经济和证券行业经验。注重宏观政策和公司微观研究相结合，善于把握结构性机会进行大类资产配置和精选价值成长公司，风格守正灵动。

（三）投资经理工作报告

1、投资策略回顾

2023年上证跌幅为5.6%，中小板指数跌幅为10.33%，创业板指数跌幅为19.36%，恒生指数跌幅为8.33%。最近三年，上证指数最高为3731，最低2893，最高回撤约22%。继2022年三大指数集体回调后，2023年指数表现依然不尽人意，电力设备、商贸零售和房地产等跌幅均在20%至30%以上，只有北证50、通信传媒计算机电子和部分高股息高分红公司表现良好。同期全球股指涨多跌少，纳斯达克以44.22%的

涨幅位居首，日经 225、标普 500、德国 DAX30、韩国综合指数也涨幅居前，但美元指数年内累计下跌 2.17%，NYMEX 原油年内累跌 10.52%，COMEX 黄金年内上涨 13.42%。

资金方面目前 M2 余额约接近 300 万亿，同比增长约 10%，北上资金 2023 年累计净流入了 437 亿元，连续 10 年净流入，累计流入约 1.77 万亿，南向资金 2023 年净流入港股达 2895 亿元，也是连续 10 年净流入，合计约 2.51 万亿元。2023 年融资余额增加约 1419.7 亿元，总额约 1.59 万亿元。居民存款余额 137 万亿，新增 16.67 万亿。2023 年 IPO 合计募集资金 3564 亿元，相较 2022 年减少了 1000 多亿。

总体 2023 年 A 股市场波动较大，而且全年是在 5 月份前上扬后迅速向下波动。产品全年仓位保持在中等仓位，主要在 AI、TMT、新能源、信创、医药、中特估中择机参与。产品上半年表现较好，净值为 1.0755，半年涨幅为 10.72%，同期上证指数涨幅 1.61%，远远跑赢大盘。但下半年由于受到宏观政策和各种海内外利空因素影响，没有及时进行止盈，导致有较大的回撤，虽然总体还跑赢大部分的指数，但还是非常可惜，后续在仓位控制和交易方面的工作上还将不断精进。

2、投资策略展望

2024 年大概率是否极泰来的一年，中国资产在全球资产的优势经过这几年充分的调整洗礼后更为突显，鉴于中国制造业和工程师红利等的优势还在，有望迎来政策面、资金面、（部分）基本面全面向好。面对未来的降息周期带来的资金相对充裕，资金面厚积薄发正在转好。全球经济的缓慢复苏带来国内除地产和高端消费以外的基本面渐渐向好。同时，国家对资本市场的重视，尤其是从融资端到投资端定位的转变，以及支持高质量发展的战略规划，经济转型以新质生产力为抓手，价值成长投资将重新回归主流，优质上市公司通过内生和外延发展将强者恒强，我们有望迎来科技和顺周期轮动的结构性牛市机会。投资策略上，主要在仓位和配置上把握结构与轮动机会，同时注意仓位控制和交易技巧，重点以新质生产力、数字经济、国央企市值管理、周期资源、新能源、创新药、必选和情绪消费等为主要配置方向，投资范围涵盖 A 股、港股、北交所和海外市场，力争产品净值有明显的回升，继续跑

赢指数的同时能创造超额收益。

（四）风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关的法律法规、集合资产管理合同与说明书，与公司相关制度进行投资运作，没有出现重大违法违规行为，投资管理各项业务均符合相关规定。

2、风险控制报告

本报告期内，金元证券针对金元证券金元鑫灏 1 号集合资产管理计划的运作特点，通过日常风险监控工作和风险预警机制，对业务运作过程中可能出现的风险状况进行全面检查，及时进行风险提示，确保集合计划运作风险水平与其投资目标一致。同时，本集合计划管理人高度重视业务一线的岗位控制，资产管理分公司内部设立风险管理岗位，日常识别、评估和防范资产管理业务中分公司职责范围内各环节各类风险，履行一线风险管理责任。

通过以上措施，在本报告期内，本集合计划管理人严格遵循有关法律法规、公司制度和本集合计划合同与说明书的约定，未出现挪用资产、与其它业务混合操作、内幕交易、操纵市场等行为，本集合计划持有的证券符合投资范围与投资比例的要求，相关的信息披露和财务数据皆真实、准确、及时。

四、集合计划托管人报告

本计划托管人—中国光大银行在托管金元证券金元鑫灏 1 号集合资产管理计划的过程中，严格遵守各项法律法规，对该产品管理人—金元证券股份有限公司 2023 年 1 月 1 日-2023 年 12 月 31 日计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和

必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害计划份额持有人利益的行为。

管理人所编制和披露的《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划 2023 年年度报告》中的财务数据是真实、准确的。

中国光大银行股份有限公司
北京分行托管业务中心
2024 年 4 月 24 日

五、审计报告

天职业字[2024]20049 号

金元鑫灏1号集合资产管理计划全体持有人：

一、审计意见

我们审计了金元鑫灏1号集合资产管理计划(以下简称“贵计划”)财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了贵计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果及净资产变动情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于贵计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基

础。

三、管理人对财务报表的责任

贵计划管理人金元证券股份有限公司（以下简称“管理人”）负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理人负责评估贵计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

四、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对贵计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致贵计划不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

五、本报告的使用范围

贵计划财务报表仅为满足中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会的监管需要之目的而编制。因此，该财务报表可能不适用于其他用途。我们的报告仅用于供贵计划管理人报送中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会使用，而不应分发至除贵计划持有人、中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会以外的其他机构或人员或其使用。

本段内容不影响已发表的审计意见。

中国·北京

二〇二四年四月八日

中国注册会计师：

中国注册会计师：

六、集合计划财务报告

(一) 集合计划会计报告书

1、集合计划资产负债表(2023年12月31日)

金额单位：人民币元

项目	年末数	年初数
资产：		
银行存款	584.19	11,067.07
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	1,103,902.74	2,092,738.36
衍生金融资产	0.00	0.00
交易性金融资产	3,893,097.26	5,636,237.50
买入返售金融资产	0.00	-615.74
发放贷款和垫款	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	15,333.80	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00

资产合计	5,012,917.99	7,739,427.19
负债:		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	12,958.56	13,722.41
应付托管费	647.95	686.07
应付销售服务费	0.00	0.00
应付投资顾问费	0.00	0.00
应交税费	0.00	20.09
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	13,606.51	14,428.57
所有者权益		
实收资金	5,456,285.08	7,952,821.08
其他综合收益	0.00	0.00
未分配利润	-456,973.60	-227,822.46
所有者权益合计	4,999,311.48	7,724,998.62
负债和所有者权益总计	5,012,917.99	7,739,427.19

注：截至2023年12月31日，集合计划单位净值0.9162元，集合计划份额总5,456,285.08份。

2、集合计划经营业绩表(2023年1月1日-2023年12月31日)

金额单位：人民币元

项目	本年数	上年数
一、收入	-20,017.29	-1,221,619.08
1. 利息收入	12,363.17	40,520.12
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-99,328.42	-853,209.96
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	66,947.96	-408,929.24
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他业务收入	0.00	0.00
二、费用	105,136.41	74,819.39
1. 管理人报酬	94,674.30	67,756.07
2. 托管费	3,603.65	3,387.73
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 投资顾问费	0.00	0.00
5. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产利息支出	0.00	0.00
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	1,858.46	-324.41
8. 其他费用	5,000.00	4,000.00
三、利润总额	-125,153.70	-1,296,438.47

减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润	-125,153.70	-1,296,438.47
五、其他综合收益	0.00	0.00
六、综合收益总额	-125,153.70	-1,296,438.47

3、集合计划所有者权益（基金净值）变动表(2023年1月1日-2023年12月31日)

金额单位：人民币元

项目	本期金额			
	实收基金	综合收益	未分配利润	所有者权益合计
一、上期期末余额	7,952,821.08		-227,822.46	7,724,998.62
加：会计政策变更				
前期差错更正				
其他				
二、本期期初余额	7,952,821.08		-227,822.46	7,724,998.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,496,536.00		-229,151.14	-2,725,687.14
（一）综合收益总额			-125,153.70	-125,153.70
（二）产品持有人申购和赎回	-2,496,536.00		-103,997.44	-2,600,533.44
其中：1、产品申购	3,541,560.37		258,439.63	3,800,000.00
2、产品赎回	-6,038,096.37		-362,437.07	-6,400,533.44
（三）利润分配			0.00	0.00
（四）其他综合收益结转留				

存收益				
四、本期期末余额	5,456,285.08		-456,973.60	4,999,311.48
项目	上期金额			
	实收基金	综合收益	未分配利润	所有者权益合计
一、上期期末余额	10,297,657.29		826,623.76	11,124,281.05
加：会计政策变更				
前期差错更正				
其他				
二、本期期初余额	10,297,657.29		826,623.76	11,124,281.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,344,836.21		-1,054,446.22	-3,399,282.43
（一）综合收益总额			-1,296,438.47	-1,296,438.47
（二）产品持有人申购和赎回	-2,344,836.21		241,992.25	-2,102,843.96
其中：1、产品申购	7,044,724.63		-44,724.63	7,000,000.00
2、产品赎回	-9,389,560.84		286,716.88	-9,102,843.96
（三）利润分配			0.00	0.00
（四）其他综合收益结转留存收益				
四、本期期末余额	7,952,821.08		-227,822.46	7,724,998.62

（二）财务报表主要项目注释

说明：期初指 2022 年 12 月 31 日，期末指 2023 年 12 月 31 日，上期指 2022 年度，本期指 2023 年度。

1. 货币资金

项目	期末余额	期初余额
银行存款	584.08	11,064.65
应计利息	0.11	2.42
<u>合计</u>	<u>584.19</u>	<u>11,067.07</u>

2. 存出保证金

项目	期末余额	期初余额
券商普通账户保证金	1,103,851.50	2,092,573.72
应计利息	51.24	164.64
<u>合计</u>	<u>1,103,902.74</u>	<u>2,092,738.36</u>

3. 应收股利

项目	期末余额	期初余额
应收基金红利	15,333.80	
<u>合计</u>	<u>15,333.80</u>	

4. 买入返售金融资产

项目	期末余额	期初余额
应计利息		-615.74
<u>合计</u>		<u>-615.74</u>

5. 交易性金融资产

项目	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		合计	
	账面价值	初始成本	账面价值	初始成本	账面价值	初始成本
股票投资	2,396,432.76	2,550,864.68			2,396,432.76	2,550,864.68
基金投资	1,496,664.50	1,570,426.10			1,496,664.50	1,570,426.10
<u>合计</u>	<u>3,893,097.26</u>	<u>4,121,290.78</u>			<u>3,893,097.26</u>	<u>4,121,290.78</u>

项目	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		合计	
	账面价值	初始成本	账面价值	初始成本	账面价值	初始成本
股票投资	5,413,496.00	5,700,463.48			5,413,496.00	5,700,463.48
基金投资	222,741.50	230,915.50			222,741.50	230,915.50
<u>合计</u>	<u>5,636,237.50</u>	<u>5,931,378.98</u>			<u>5,636,237.50</u>	<u>5,931,378.98</u>

6. 应付管理人报酬

项目	期末余额	期初余额
应付管理费	12,958.56	13,722.41
<u>合计</u>	<u>12,958.56</u>	<u>13,722.41</u>

7. 应付托管费

项目	期末余额	期初余额
应付托管费	647.95	686.07
<u>合计</u>	<u>647.95</u>	<u>686.07</u>

8. 应交税费

税费项目	期末余额	期初余额
增值税		17.94
城市维护建设税		1.25
教育费附加		0.54
地方教育附加		0.36
<u>合计</u>		<u>20.09</u>

9. 实收资金

项目	期初余额	本期申购	本期赎回	期末余额
实收资金	7,952,821.08	3,541,560.37	6,038,096.37	5,456,285.08
<u>合计</u>	<u>7,952,821.08</u>	<u>3,541,560.37</u>	<u>6,038,096.37</u>	<u>5,456,285.08</u>

10. 未分配利润

项目	本期金额	上期金额
一、期初余额	-227,822.46	826,623.76
二、本期净利润转入	-125,153.70	-1,296,438.47
三、本期增减变动额（减少以“-”列示）	<u>-103,997.44</u>	<u>241,992.25</u>
其中：1. 计划申购款	258,439.63	-44,724.63
2. 计划赎回款	-362,437.07	286,716.88
3. 分配		
四、期末余额	-456,973.60	-227,822.46

11. 利息收入

项目	本期发生额	上期发生额
银行存款利息收入	496.28	6,382.89

项目	本期发生额	上期发生额
存出保证金利息收入	3,494.32	10,466.84
买入返售证券利息收入	8,623.79	24,380.56
增值税贷款服务抵减	-251.22	-710.17
<u>合计</u>	<u>12,363.17</u>	<u>40,520.12</u>

12. 投资收益

项目	本期发生额	上期发生额
处置金融工具取得的收益	-149,033.56	-825,326.46
其中：股票投资收益	-102,126.60	-859,174.46
基金投资收益	-31,671.00	33,848.00
差价收入增值税抵减	-15,235.96	
持有金融工具期间取得的收益	79,107.39	3,385.14
其中：股票股利收益	63,773.59	1,229.58
基金红利收入	15,333.80	2,155.56
交易费用	-29,402.25	-31,268.64
<u>合计</u>	<u>-99,328.42</u>	<u>-853,209.96</u>

13. 公允价值变动收益

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产公允价值变动收益	66,947.96	-412,342.87
暂估增值税抵减		3,413.63
<u>合计</u>	<u>66,947.96</u>	<u>-408,929.24</u>

14. 管理人报酬

项目	本期发生额	上期发生额
----	-------	-------

项目	本期发生额	上期发生额
管理费	72,072.14	67,756.07
业绩报酬	22,602.16	
<u>合计</u>	<u>94,674.30</u>	<u>67,756.07</u>

15. 托管费

项目	本期发生额	上期发生额
托管费	3,603.65	3,387.73
<u>合计</u>	<u>3,603.65</u>	<u>3,387.73</u>

16. 税金及附加

项目	本期发生额	上期发生额
城市维护建设税	1,084.11	-189.24
教育费附加	464.60	-81.11
地方教育附加	309.75	-54.06
<u>合计</u>	<u>1,858.46</u>	<u>-324.41</u>

17. 其他费用

项目	本期发生额	上期发生额
审计费用	5,000.00	4,000.00
<u>合计</u>	<u>5,000.00</u>	<u>4,000.00</u>

(三) 集合计划的费用、业绩报酬

1、管理人的管理费

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1%年费率计提,计算方法如下:

$$M = E \times 1\% / 365$$

M为每日应计提的集合计划管理费;

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，按季支付。次一季度首日起5个交易日内由管理人向托管人出具划款指令，托管人根据划款指令在3个交易日内将上季度计提的管理费从集合计划资产中一次性支付给管理人。

2、托管人的托管费

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%年费率计提，计算方法如下：

$$K=N\times 0.05\%\div 365$$

K为每日应计提的集合计划托管费

N为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，按季支付。次一季度首日起5个交易日内由管理人向托管人出具划款指令，托管人根据划款指令在3个交易日内将上季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人。

3、管理人提取业绩报酬

- 在本计划分红日、终止日（含提前终止日）及投资者退出日，若集合计划年化净收益率大于等于业绩报酬计提基准5%时，管理人对集合计划年化净收益率大于等于业绩报酬计提基准5%部分计提20%作为业绩报酬。具体计算方法：
- 按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；
- 符合业绩报酬计提条件时，在业绩报酬计提基准日（集合计划分红日、投资者退出日及计划终止日）计提业绩报酬；
- 分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；
- 在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。业绩报酬计提份额采取先进先出法，最早申购的份额，在赎回时最先退出，计提

超额业绩报酬根据相应份额的年化收益率提取业绩报酬。

- 在单个业绩报酬计算期间内，若产品年化收益高于或等于5%/年，则超过部分提取20%作为业绩报酬。
- 业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次。因投资者退出集合计划，管理人按照合同约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

具体业绩报酬计提公式如下：

以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，募集期参与的为集合计划成立日，开放期参与的为参与当日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算方法如下：

$$R = \frac{A - N}{N} \div T \times 100\%$$

其中：R=年化收益率

A=业绩报酬计提日的单位累计净值（当日计提业绩报酬前）

N=上一个发生业绩报酬计提日的单位累计净值

N_0 =上一个发生业绩报酬计提日的单位净值

T=该计划份额持有人上一个发生业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日之间的实际天数/365

业绩报酬计提比例：

管理人对集合计划份额年化收益率超过或等于 5%的部分提取 20%作为业绩报酬，

具体的业绩报酬计算公式如下：

年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式
$R < 5\%$	0	$E = 0$
$R \geq 5\%$	20%	$E = (R - 5\%) \times C \times T \times 20\%$

其中：E 为业绩报酬，R 为集合计划份额年化收益率，C 为投资者当日退出份额数量或业绩报酬计提基准日持有的份额数量×上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日集合计划份额的单位净值，T 为投资者自上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日持有份额的自然日天数与 365 的比值。

管理人的业绩报酬计算和复核工作由管理人完成。管理人向托管人发送划付指令，托管人根据收到的指令于 3 个工作日内将业绩报酬从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定假日、休息日，支付日期顺延。业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的责任。

4、管理人报酬、托管费本期发生额

公司名称	内容	本期发生额	上期发生额
金元证券股份有限公司	管理费	72,072.14	67,756.07
金元证券股份有限公司	业绩报酬	22,602.16	
中国光大银行股份有限公司 北京分行	托管费	3,603.65	3,387.73

七、集合计划投资组合报告（2023 年 12 月 31 日）

（一）期末集合计划资产组合情况

项目	期末市值（元）	占总资产比例（%）
银行存款和结算备付金	584.19	0.01
股票	2,396,432.76	47.81
债券	0.00	0.00
基金	1,496,664.50	29.86
资产支持证券投资	0.00	0.00
买入返售证券	0.00	0.00
其他资产	1,119,236.54	22.32

合计	5,012,917.99	100.00
----	--------------	--------

注1：“其他资产”包括：“存出保证金”、“应收股利”、“应收证券清算款证券”等项目。

注2：因四舍五入原因，期末集合计划资产组合情况中期末市值占总资产比例的分项之和与合计可能存在误差。

（二）集合计划份额变动

	单位：份
期初份额总额	7,952,821.08
报告期间总参与份额	3,541,560.37
红利再投资份额	0.00
报告期总退出份额	6,038,096.37
报告期末总份额	5,456,285.08

八、重要事项提示

（一）本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

（二）本集合计划聘请的会计师事务所没有发生变更。

（三）本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

（四）本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

（五）本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

（六）本集合计划管理人于 2023 年 4 月 3 日披露了金元鑫灏 1 号集合资产管

理计划资产管理合同变更的公告，经管理人和托管人协商一致，并签订《金元鑫灏1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议三》，对《金元鑫灏1号集合资产管理计划资产管理合同》的相关条款进行变更及同步更新《金元鑫灏1号集合资产管理计划说明书》，变更后的合同于2023年4月3日生效。

（七）本集合计划管理人于2023年4月3日披露了金元鑫灏1号集合资产管理计划管理人自有资金拟参与的公告，对本次自有资金拟参与事项以网站公告的形式向委托人征询意见。

（八）本集合计划管理人于2023年4月11日披露了金元鑫灏1号集合资产管理计划管理人自有资金参与的公告，我公司在向委托人征询意见后，按约定将于2023年4月12日以自有资金1,400,000.00元参与本集合计划，参与比例不高于15%，符合合同约定。

（九）本集合计划管理人于2023年7月3日披露了金元鑫灏1号集合资产管理计划资产管理合同变更的公告及合同补充协议等，根据合同约定，管理人就合同变更事项以网站公告的形式向委托人征询意见。

（十）本集合计划管理人于2023年7月7日披露金元鑫灏1号集合资产管理计划资产管理合同变更生效公告，截至2023年7月6日，合同变更征询意见期结束，本集合计划合同变更事项于2023年7月7日生效。

（十一）本集合计划管理人于2023年7月13日披露了金元鑫灏1号集合资产管理计划管理人自有资金退出的公告，因开放期投资者退出导致自有资金参与比例超15%，根据合同约定，我公司同步退出自有资金651,866.30份。本次自有资金退出后，本集合计划总份额为3,932,860.41份，其中管理人自有资金实际参与本集合计划的份额为589,928.98份，占集合计划总份额比例15%，符合合同约定。

（十二）本集合计划管理人于2023年7月13日披露了金元鑫灏1号集合资产管理计划巨额退出公告，因2023年7月6日开放期间净退出份额超过上一日集合计

划总份额的10%，形成了巨额退出，根据合同约定管理人已对2023年7月6日的退出申请按全额确认退出方式处理。

（十三）本集合计划管理人于2023年8月10日披露了金元鑫灏1号集合资产管理计划管理人自有资金退出的公告，因开放期投资者退出导致自有资金参与比例超15%，根据合同约定，我公司同步退出自有资金62,946.44份。本次自有资金退出后，本集合计划总份额为3,513,216.98份，其中管理人自有资金实际参与本集合计划的份额为526,982.54份，占集合计划总份额比例15%，符合合同约定。

（十四）本集合计划管理人于2023年10月12日披露了金元鑫灏1号集合资产管理计划投资经理变更的公告，自2023年10月13日起增加杨宜霏女士担任本集合计划投资经理，本集合计划投资经理现由陈勇先生及杨宜霏女士共同担任。

九、关联方关系

（一）管理人关联方名单

金元证券股份有限公司关联方名单		
关联方	名称/姓名	备注
母公司	首都机场集团有限公司	公司控股股东
公司独立董事任职企业	安徽国耀创业投资管理有限公司	独立董事张俊任职单位
	厦门国家会计学院	独立董事陈爱华任职单位
	北京市康达（深圳）律师事务所	独立董事向南任职单位

<p>公司根据实质重于形式原则认定的其他与公司有特殊关系，可能导致公司利益对其倾斜的法人或其他组织，包括持有对公司具有重要影响的控股子公司10%以上股份的法人或其他组织等</p>	<p>上海前易信息咨询服务有限公司</p>	<p>公司子公司金元顺安基金管理有限公司另一股东</p>
<p>子、孙公司</p>	<p>金元期货股份有限公司</p>	<p>公司下属1级单位</p>
	<p>金元顺安基金管理有限公司</p>	<p>公司下属1级单位</p>
	<p>金元资本投资管理（深圳）有限公司</p>	<p>公司下属1级单位</p>
	<p>上海金元百利资产管理有限公司</p>	<p>公司下属2级单位</p>
<p>受同一母公司控制的其他企业</p>	<p>北京首都国际机场股份有限公司</p>	<p>集团下属1级单位</p>
	<p>天津滨海国际机场有限公司</p>	<p>集团下属1级单位</p>
	<p>天津市天航汽车运输有限公司</p>	<p>集团下属2级单位</p>
	<p>天津滨海国际航空物流有限公司</p>	<p>集团下属2级单位</p>
	<p>天津蓝海苑物业管理有限公司</p>	<p>集团下属2级单位</p>
	<p>江西省机场集团有限公司</p>	<p>集团下属1级单位</p>
	<p>江西省机场集团空港服务有限公司</p>	<p>集团下属2级单位</p>
	<p>江西民航置业有限公司</p>	<p>集团下属2级单位</p>
	<p>江西空港航空地面服务有限公司</p>	<p>集团下属2级单位</p>
	<p>南昌昌北国际机场有限公司</p>	<p>集团下属2级单位</p>
	<p>吉林省民航机场集团有限公司</p>	<p>集团下属1级单位</p>
<p>吉林空港航空地面服务有限公司</p>	<p>集团下属2级单位</p>	

	吉林省大地绿化工程有限公司	集团下属 2 级单位
	吉林省空港航空服务有限责任公司	集团下属 2 级单位
	吉林省强华房地产开发有限公司	集团下属 2 级单位
	吉林省翔云航空服务有限责任公司	集团下属 2 级单位
	首都机场临空发展集团有限公司	集团下属 1 级单位
	三亚首地兴业置业有限公司	集团下属 2 级单位
	深圳市优地房地产开发有限公司	集团下属 2 级单位
	北京首地兴业置业有限公司	集团下属 2 级单位
	重庆首地房地产开发有限公司	集团下属 2 级单位
	武汉首地兴业房地产开发有限公司	集团下属 2 级单位
	吉林省首地房地产开发有限公司	集团下属 2 级单位
	湖北首地房地产开发有限公司	集团下属 2 级单位
	内蒙古首地房地产开发有限公司	集团下属 2 级单位
	三亚（首都机场）投资开发有限公司	集团下属 2 级单位
	三亚（首都机场）物业管理有限公司	集团下属 3 级单位
	江西首地置业有限公司	集团下属 2 级单位
	天津航空产业开发有限公司	集团下属 2 级单位
	中航鑫港担保有限公司	集团下属 1 级单位
	首都机场（北京）融资担保有限公司	集团下属 2 级单位

中航鑫港（天津）商业保理有限公司	集团下属2级单位
北京首都机场旅业有限公司	集团下属1级单位
北京首都机场航空服务有限公司	集团下属2级单位
北京星空国际旅行社有限公司	集团下属3级单位
北京首都机场蓝天广告有限公司	集团下属2级单位
北京京瑞饭店管理有限责任公司	集团下属2级单位
首都空港贵宾服务管理有限公司	集团下属1级单位
天津空港贵宾服务有限公司	集团下属2级单位
江西空港贵宾服务有限公司	集团下属2级单位
贵州空港商务服务有限公司	集团下属2级单位
吉林空港贵宾服务有限公司	集团下属2级单位
黑龙江空港贵宾服务有限公司	集团下属2级单位
内蒙古空港贵宾服务有限公司	集团下属2级单位
河北空港贵宾服务有限公司	集团下属2级单位
山西空港贵宾服务有限公司	集团下属2级单位
北京首都机场商贸有限公司	集团下属1级单位
河北机场商业发展有限公司	集团下属2级单位
首都机场集团传媒有限公司	集团下属1级单位
襄阳机场传媒有限公司	集团下属2级单位
北京首都机场餐饮发展有限公司	集团下属1级单位
北京空港航空地面服务有限公司	集团下属1级单位
北京首都机场物业管理有限公司	集团下属1级单位
北京航港园林绿化有限公司	集团下属2级单位
北京首都机场房地产经纪有限公司	集团下属2级单位

司	
北京首都机场动力能源有限公司	集团下属 1 级单位
北京首都机场节能技术服务有限公司	集团下属 2 级单位
北京中鹏饮料水有限公司	集团下属 2 级单位
北京首都机场航空安保有限公司	集团下属 1 级单位
北京空港赛瑞安防科技有限公司	集团下属 2 级单位
首都机场集团财务有限公司	集团下属 1 级单位
首都机场集团商务航空管理有限公司	集团下属 1 级单位
首都公务机有限公司	集团下属 2 级单位
首都机场集团资产管理有限公司	集团下属 1 级单位
深圳市新方汇达投资发展有限公司	集团下属 2 级单位
深圳市凯美豪盛酒店物业管理有 限公司	集团下属 3 级单位
北京信通大厦有限公司	集团下属 2 级单位
航港金控投资有限公司	集团下属 2 级单位
荆州长江城市建设发展投资有 限公司	集团下属 3 级单位
北京大兴国际机场航空食品有 限公司	集团下属 1 级单位
北京首新航空地面服务有限公司	集团下属 1 级单位
北京民航机场巴士有限公司	集团下属 1 级单位
北京空港开远客运有限公司	集团下属 2 级单位

	北京空港兴航达客运有限公司	集团下属2级单位
	北京兴航达客运服务有限公司	集团下属3级单位
	北京空港通力客运场站经营有限公司	集团下属2级单位
	北京通力联合汽车维修有限公司	集团下属2级单位
	北京民航安乐出租汽车有限责任公司	集团下属2级单位
	首都机场集团设备运维管理有限公司	集团下属1级单位
	北京博维航空设施管理有限公司	集团下属2级单位
	首都机场集团科技管理有限公司	集团下属1级单位
	北京创联民航技术有限公司	集团下属2级单位
	北京司拓民航科技有限责任公司	集团下属3级单位
	北京金飞民航经济发展有限公司	集团下属1级单位
	瑞海姆田园度假村有限公司	集团下属1级单位
	北京京瑞房产有限公司	集团下属1级单位
对公司施加重大影响的投资方	深圳市润隆乐华投资有限公司	公司股东
	佛山市乐华恒业实业投资有限公司	对公司股东有重大影响的上1级单位
	佛山市霍陈贸易有限公司	对公司股东有重大影响的上2级单位
	江苏东方盛虹股份有限公司	公司股东
	江苏盛虹科技股份有限公司	对公司股东有重大影响的上1级单位
	江苏盛虹新材料集团有限公司	对公司股东有重大

		影响的上 2 级单位
	盛虹（苏州）集团有限公司	对公司股东有重大影响的上 3 级单位
	广州市黄埔龙之泉实业有限公司	公司股东
	广州市龙的投资股份有限公司	对公司股东有重大影响的上 1 级单位
	海口市创新产业投资有限公司	公司股东
	海口市国有资产经营有限公司	对公司股东有重大影响的上 1 级单位
	厦门科华伟业股份有限公司	公司股东
公司关键管理人员	陆涛	公司董事、董事长
	郭长洲	公司董事、总经理
	付华杰	公司董事
	林怀宇	公司董事
	张俊	公司董事（独立董事）
	陈爱华	公司董事（独立董事）
	向南	公司董事（独立董事）
	王鸿武	公司监事、监事会主席
	谢敏敏	公司监事
	卜巍巍	公司监事（职工监事）

	吴毓锋	公司高管（副总经理、首席信息官）
	王晖	公司高管（副总经理）
	云琳	公司高管（合规总监、首席风险官）
	田原	公司高管（副总经理）
	方琛	公司高管（副总经理）
母公司主要领导	沈兰成	母公司分管公司主要领导
注：公司无对公司实施共同控制的投资方、无合营企业、无联营企业、无投资者个人，公司及母公司关键管理人员无《企业会计准则第36号--关联方披露》规定的与公司及母公司关键管理人员关系密切的家庭成员，公司关键管理人员无控制、共同控制或施加重大影响的其他企业。		

（二）托管人关联方名单

中国光大银行股份有限公司关联方名单	
中国光大银行股份有限公司	本公司
中国光大集团股份公司	控股股东
华侨城集团有限公司	前十名股东持股
申能（集团）有限公司	前十名股东持股
中国光大控股有限公司	前十名股东持股

中国人寿再保险有限责任公司	前十名股东持股
中国再保险（集团）股份有限公司	前十名股东持股
中远海运（上海）投资管理有限公司	前十名股东持股
中国光大环境（集团）有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
China Everbright Environment Group Limited	关联方“中国光大环境（集团）有限公司”的英文名称
中国光大环境集团有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
China Everbright Environmental Group Limited	关联方“中国光大环境集团有限公司”的英文名称
北京光元泰合医学诊断技术有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
光大（北京）医疗健康科技有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
光大金控资产管理有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
光大金瓯资产管理有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
光大科技有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
光大兴陇信托有限责任公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
光大永明人寿保险有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
光大永年有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
光大证券股份有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
嘉事堂药业股份有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
中国光大集团有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
中国光大实业（集团）有限责任	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司

公司	
中国光大医疗健康产业有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
中国青旅集团有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
中青旅控股股份有限公司	控股股东中国光大集团股份公司控参股的其他境内外上市公司
Ocean Fortune Investment Limited	年报披露股权关系
北京阳光消费金融股份有限公司	年报披露股权关系
光大金融租赁股份有限公司	年报披露股权关系
光大理财有限责任公司	年报披露股权关系
光银国际投资有限公司	年报披露股权关系
江苏淮安光大村镇银行股份有限 公司	年报披露股权关系
江西瑞金光大村镇银行股份有限 公司	年报披露股权关系
美光恩御（上海）置业有限公司	年报披露股权关系
韶山光大村镇银行股份有限公司	年报披露股权关系
中国光大投资管理有限责任公司	年报披露股权关系
中国光大银行股份有限公司（欧 洲）	年报披露股权关系
中国远洋海运集团有限公司	年报披露股权关系
中远海运金融控股有限公司	年报披露股权关系（20230831 从名单剔除，1 年后生效）
中远海运投资控股有限公司	年报披露股权关系
中国华融资产管理股份有限公司	公告披露股权关系
中国投资有限责任公司	实际控制人
香港中央结算（代理人）有限公	前十名股东

司	
香港中央结算有限公司	前十名股东
中国证券金融股份有限公司	前十名股东

十、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、中国证券投资基金业协会《金元鑫灏1号集合资产管理计划的备案证明》
- 2、《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划说明书》
- 3、《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划合同》
- 4、《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划托管协议》
- 5、《金元鑫灏1号集合资产管理计划风险揭示书》
- 6、《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划验资报告》
- 7、管理人业务资格批件、营业执照
- 8、《金元鑫灏1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议一》
- 9、《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划说明书》（2020年10月变更）
- 10、《金元鑫灏1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议二》
- 11、《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划说明书》（2022年9月变更）
- 12、《金元鑫灏1号集合资产管理计划风险揭示书》（2022年9月变更）
- 13、《金元鑫灏1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议三》
- 14、《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划说明书》（2023年4月变更）
- 15、《金元鑫灏1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议四》
- 16、《金元证券金元鑫灏1号集合资产管理计划说明书》（2023年7月变更）

（二）存放地点及查阅方式

查阅地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼

网址：www.jyzq.cn

客户服务热线：95372

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人金元证券股份有限公司。


金元证券股份有限公司
二〇二四年四月二十五日

