

---

# 金元证券尊享定制年年红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：浙商银行股份有限公司

报告期间：2023年5月9日至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25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5月9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 .....	4
三、集合计划管理人报告 .....	6
四、集合计划托管人报告 .....	8
五、审计报告 .....	9
六、集合计划财务报告 .....	11
七、集合计划投资组合报告（2023 年 12 月 31 日） .....	24
八、重要事项提示 .....	25
九、关联方关系 .....	26
十、备查文件目录 .....	42

## 一、集合计划产品概况

名称：金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2023年05月09日

报告期末计划总份额:64,717,723.04 份

存续期：10年

投资目标：本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

投资范围：（1）包括但不限于在交易所/银行间市场发行的国债、央行票据、地方政府债、同业存单、各类金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债）、企业债券、公司债券、永续债、可转债、可交债、经银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具或交易所发行的各类债券工具等（含短期融资券、中期票据、超短融 SCP、非公开定向融资工具 PPN、资产证券化产品：ABS、ABN 等）。

（2）货币市场工具和存款工具：包括但不限于现金、债券回购、银行存款、大额可转让存单等。

（3）固定收益类基金：包括但不限于货币基金、债券基金等。

（4）监管机构（人行、交易商协会、证监会、银保监会、发改委等）认可的其他标准化资产。

托管人：浙商银行股份有限公司

披露网址：[www.jyzq.cn](http://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5月9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	863,042.40
本期利润	1,648,106.48
其中：本期公允价值变动损益	785,064.08
本期单位净值增长率	3.6100%
期末可分配利润	1,401,109.30
期末可供分配份额利润	0.0216
期末资产净值	67,055,256.98
期末单位资产净值	1.0361
单位累计净值增长率	3.6100%

## (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	2.2400%
过去一年	3.6100%
本计划成立至本报告期末	3.6100%

注:本计划成立日为2023年5月9日。

## 2、本计划累计净值增长率历史走势图



## (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2023年5月9日成立，截至2023年12月31日，集合计划单位净值为1.0361元，累计单位净值为1.0361元。

## （二）投资主办简介

梁乐健先生，西南财经大学金融学硕士。历任金元证券投资管理部投资助理，金元证券资产管理分公司合规风控、交易员、研究员、投资经理，先后从事制度流程建设、交易、研究、投资管理等工作。熟悉资产管理的各环节业务，拥有丰富的研究及投资经验，注重基本面研究与数量分析相结合。

## （三）投资主办工作报告

### 1、投资策略回顾

2023 年全年，债市收益率整体呈 N 型走势。10 年期国债利率全年累计下行 26.75bp，1 年期国债利率累计下行 3.24bp。全年来看，走势分为三个阶段：年初至 1 月底，理财赎回负反馈余波叠加经济回升预期，利率上行。春节后至 8 月下旬，债市开启了一段长达 5 个月的牛市，其中 3 月至 7 月底，资金面转松+经济回落，债市走牛；7 月底债市小幅调整后，8 月，基本面继续走弱叠加超预期降息，10 年国债下探至 2.54% 的年内低点。8 月下旬至年底，稳增长政策密集出台、资金面收敛和基本面小幅修复，债市调整，存单利率上行，利率曲线平坦化。

信用债方面，在化债工作的持续推进下，“资产荒”行情助推信用债收益率全面下行。产品投资策略以资产配置为主，波段操作为辅，把握利率债投资机会，挖掘部分区域信用债的投资价值。

### 2、投资管理展望

展望 2024 年，预计宏观经济环境仍为弱修复格局，通胀维持低位，货币政策也存在宽松预期，因此整体环境对债券市场仍较为友好。未来将关注利率债及信用债的投资机会，根据市场情况选择合适的投资策略。

## （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尊享定制年年红 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

我部对于贵司编制的《金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划 2023 年年度报告》中的财务指标、净值表现、投资组合报告进行了复核，复核内容无误。

特此确认。

浙商银行资产托管部

2024 年 04 月 25 日



## 五、审计报告

天职业字[2024]20052 号

金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划全体持有人：

### 一、审计意见

我们审计了金元证券尊享定制年年红 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 5 月 9 日(成立日)至 2023 年 12 月 31 日的利润表、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 5 月 9 日(成立日)至 2023 年 12 月 31 日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，就可能导致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为其使用。

本段内容不影响已发表的审计意见。

中国注册会计师：

中国·北京

二〇二四年四月八日

中国注册会计师：

## 六、集合计划财务报告

### （一）集合计划财务报表

#### 1、集合计划资产负债表(2023年12月31日)

项目	年末数	年初数
<b>资产：</b>		
银行存款	977,878.98	0.00
结算备付金	530,394.45	0.00
存出保证金	2,122.64	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
交易性金融资产	92,521,632.70	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
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	0.08	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	94,032,028.85	0.00
<b>负债：</b>		
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	26,844,881.10	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	70,921.80	0.00

应付托管费	2,364.09	0.00
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	56,976.76	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	1,628.12	0.00
负债合计	26,976,771.87	0.00
所有者权益		
实收资金	64,717,723.04	0.00
其他综合收益	0.00	0.00
未分配利润	2,337,533.94	0.00
所有者权益合计	67,055,256.98	0.00
负债和所有者权益总计	94,032,028.85	0.00

注：截至2023年12月31日，集合计划单位净值1.0361元，集合计划份额总64,717,723.04份。

## 2、集合计划经营业绩表(2023年5月9日至2023年12月31日)

项目	本年数	上年数
一、收入	2,011,385.28	0.00
1. 利息收入	8,567.14	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,217,754.06	0.00
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）	785,064.08	0.00

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	363,278.80	0.00
1. 管理人报酬	154,101.44	0.00
2. 托管费	5,136.76	0.00
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	187,811.26	0.00
其中：卖出回购金融资产利息支出	187,811.26	0.00
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	6,529.34	0.00
8. 其他费用	9,700.00	0.00
三、利润总额	1,648,106.48	0.00
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润	1,648,106.48	0.00
五、其他综合收益	0.00	0.00
六、综合收益总额	1,648,106.48	0.00

## 3、集合计划所有者权益（基金净值）变动表(2023年5月9日至2023年12月31日)

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	34,907,150.50		0.00	34,907,150.50

加：会计政策变更				
前期差错更正				
其他				
二、本期期初余额	34,907,150.50		0.00	34,907,150.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	29,810,572.54		2,337,533.94	32,148,106.48
（一）综合收益总额			1,648,106.48	1,648,106.48
（二）产品持有人申购和赎回	29,810,572.54		689,427.46	30,500,000.00
其中：1、产品申购	29,810,572.54		689,427.46	30,500,000.00
2、产品赎回	0.00		0.00	0.00
（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	64,717,723.04		2,337,533.94	67,055,256.98
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	0.00		0.00	0.00
加：会计政策变更				
前期差错更正				
其他				
二、本期期初余额	0.00		0.00	0.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	0.00		0.00	0.00
（一）综合收益总额			0.00	0.00

(二) 产品持有人申购和赎回	0.00		0.00	0.00
其中：1、产品申购	0.00		0.00	0.00
2、产品赎回	0.00		0.00	0.00
(三) 利润分配			0.00	0.00
(四) 其他综合收益结转留存收益				
<b>四、本期期末余额</b>	<b>0.00</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

## (二) 财务报表主要项目注释

说明：期初指 2023 年 5 月 9 日（成立日），期末指 2023 年 12 月 31 日，本期指 2023 年 5 月 9 日（成立日）至 2023 年 12 月 31 日。

### 1. 货币资金

项目	期末余额
银行存款	977,798.49
应计利息	80.49
<u>合计</u>	<u>977,878.98</u>

### 2. 结算备付金

项目	期末余额
上交所结算备付金	530,131.99
应计利息	262.46
<u>合计</u>	<u>530,394.45</u>

### 3. 存出保证金

项目	期末余额
----	------



项目	期末余额
上交所结算保证金	2,121.54
应计利息	1.10
<u>合计</u>	<u>2,122.64</u>

4. 应收股利

项目	期末余额
应收基金红利	0.08
<u>合计</u>	<u>0.08</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
基金投资	208.25	208.25			208.25	208.25
债券投资	92,521,424.45	88,981,973.00			92,521,424.45	88,981,973.00
<u>合计</u>	<u>92,521,632.70</u>	<u>88,982,181.25</u>			<u>92,521,632.70</u>	<u>88,982,181.25</u>

6. 卖出回购金融资产款

项目	期末余额
质押式卖出回购	26,809,784.94
应计利息	35,096.16

项目	期末余额
<u>合计</u>	<u>26,844,881.10</u>

## 7. 应付管理人报酬

项目	期末余额
应付管理费	70,921.80
<u>合计</u>	<u>70,921.80</u>

## 8. 应付托管费

项目	期末余额
应付托管费	2,364.09
<u>合计</u>	<u>2,364.09</u>

## 9. 应交税费

税费项目	期末余额
增值税	50,872.11
城市维护建设税	3,561.04
教育费附加	1,526.17
地方教育附加	1,017.44
<u>合计</u>	<u>56,976.76</u>

## 10. 其他负债

项目	期末余额
应付银行间交易费用	1,628.12
<u>合计</u>	<u>1,628.12</u>

## 11. 实收资金

项目	期初余额	本期申购	本期赎回	期末余额
----	------	------	------	------

项目	期初余额	本期申购	本期赎回	期末余额
实收资金	34,907,150.50	29,810,572.54		64,717,723.04
<u>合计</u>	<u>34,907,150.50</u>	<u>29,810,572.54</u>		<u>64,717,723.04</u>

12. 未分配利润

项目	本期金额
一、期初余额	
二、本期净利润转入	1,648,106.48
三、本期增减变动额（减少以“-”列示）	<u>689,427.46</u>
其中：1. 计划申购款	689,427.46
2. 计划赎回款	
3. 分配	
四、期末余额	2,337,533.94

13. 利息收入

项目	本期发生额
银行存款利息收入	1,246.40
结算备付金利息收入	3,233.48
存出保证金利息收入	24.41
买入返售证券利息收入	4,119.57
增值税贷款服务抵减	-56.72
<u>合计</u>	<u>8,567.14</u>

14. 投资收益

项目	本期发生额
持有金融工具期间取得的收益	<u>1,220,500.21</u>
其中：基金红利收入	55,582.26

项目	本期发生额
债券利息收入	1,195,720.43
利息收入增值税抵减	-30,802.48
交易费用	-2,746.15
<u>合计</u>	<u>1,217,754.06</u>

## 15. 公允价值变动收益

项目	本期发生额
交易性金融资产公允价值变动收益	808,616.00
暂估增值税抵减	-23,551.92
<u>合计</u>	<u>785,064.08</u>

## 16. 管理人报酬

项目	本期发生额
管理费	154,101.44
<u>合计</u>	<u>154,101.44</u>

## 17. 托管费

项目	本期发生额
托管费	5,136.76
<u>合计</u>	<u>5,136.76</u>

## 18. 利息支出

项目	本期发生额
卖出回购金融资产款利息支出	187,811.26
<u>合计</u>	<u>187,811.26</u>

## 19. 税金及附加

项目	本期发生额
城市维护建设税	3,808.78
教育费附加	1,632.34
地方教育附加	1,088.22
<u>合计</u>	<u>6,529.34</u>

## 20. 其他费用

项目	本期发生额
账户维护费	9,700.00
<u>合计</u>	<u>9,700.00</u>

**(三) 集合计划的费用、业绩报酬**

## 1、管理费

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%年费率计提，计算方法如下：

$$M = E \times 0.6\% / 365$$

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、业绩报酬：

在本计划分红日、投资者退出日、本计划终止日，若集合计划年化净收益率大于业绩报酬计提基准G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G部分计提60%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；

在业绩报酬计提日（集合计划分红日、投资者退出日、本计划终止日），符合业绩报酬计提条件时计提业绩报酬；

以上一业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日作为业绩报酬的计提区间，无论上一业绩报酬计提日是否计提业绩报酬。如上一业绩报酬计提日不存在，募集期参与的为集合计划的成立日、开放期参与的为参与份额的确认日作为上一报酬计提日。

分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，且从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每 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。

在投资者退出或计划终止清算时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。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。

若投资人持有计划份额期间，发生业绩报酬计提基准调整，需分别计算，调整前后不同时间区间内的年化收益率，并加总计算管理人业绩报酬。

投资者的某笔份额在持有期内如果存在有多个业绩报酬计算周期（分红日、业绩报酬计提日、业绩报酬计提基准生效日都会引发新的业绩报酬计算周期），每个周期有相同或者不同的业绩报酬计提基准。每个周期收益率单独计算，该收益率与该周期业绩报酬计提基准相比后计算提成比例。最后将每个周期计算的业绩报酬加总，作为最终的业绩报酬计提取值。

年化收益率的计算方法如下：

$$R_{i,j} = (P_{i,j} - P_{i,j-1}) / A_{i,j-1} \div T * 365$$

其中： $R_{i,j}$  = 第  $i$  笔份额在第  $j$  个业绩报酬计算节点（每个业绩报酬计提基准生效日、分红日、业绩报酬计提日）的年化收益率；

$P_{i,j}$  = 第  $i$  笔份额在第  $j$  个业绩报酬计算节点的累计单位净值（如果  $j=1$ ，则为上一业绩报酬计提日或分红日的累计单位净值，若上一业绩报酬计提日或分红日不存在，则为成立日或参与份额的确认的累计单位净值）；

$A_{i,j-1}$ =第 i 笔份额在第 j-1 个业绩报酬计算节点的单位净值（如果 j=1，则为上一业绩报酬计提日或分红日的单位净值，若上一业绩报酬计提日或分红日不存在，则为成立日或参与份额的确认的单位净值）；

T=第 j-1 个业绩报酬计算节点（当 j=1 时，则为上一业绩报酬计提日或分红日，若上一业绩报酬计提日或分红日不存在，则为成立日或参与份额的确认日）（含）到第 j 个业绩报酬计算节点（不含）的天数。

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
$R_{i,j} < G_{i,j}$	0	$F_{i,j} = 0$
$R_{i,j} \geq G_{i,j}$	60%	$F_{i,j} = (R_{i,j} - G_{i,j}) \times C_{i,j} \times T / 365 \times 60\%$

其中： $F_{i,j}$ =第 i 笔份额在第 j 个业绩报酬计算节点计提的业绩报酬；

$G_{i,j}$ =第 i 笔份额在第 j-1 个业绩报酬计算节点上生效的业绩报酬计提基准；

$C_{i,j}$ =第 i 笔份额的份额数量  $\times A_{i,j-1}$ ；

将所有业绩报酬计算节点的业绩报酬加总，得到退出/分红份额对应的业绩报酬

F：

$$F = \sum F_{i,j}$$

业绩报酬计提基准现为 3.9%。

### 3、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 0.02% 年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 0.02\% \div 365$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费自本计划成立之日起每日计提，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，托管人复核后根据划款指令在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。

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
金元证券股份有限公司	管理费	154,101.44
浙商银行股份有限公司	托管费	5,136.76

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	1,508,273.43	1.60
股票	0.00	0.00
债券	92,521,424.45	98.39
基金	208.25	0.00
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	2,122.72	0.01
合计	94,032,028.85	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	34,907,150.50
报告期间总参与份额	29,810,572.54
红利再投资份额	0.00
报告期总退出份额	0.00
报告期末总份额	64,717,723.04

## 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）本集合计划管理人、托管人没有发生变更。

（三）本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

（四）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。

（五）本报告期内无关联交易事项。

（六）本报告期内未发生投资经理变更事项。

（七）本集合计划有1名我司员工鲍敏参与，有效参与资金及利息为300,013.50元，折合为300,013.50份本集合计划份额。截止2023年12月31日本集合计划关联方（公司员工）持有300,013.5份，持有份额不变。

（八）本集合计划管理人于2023年10月24日披露了金元证券尊享定制年年红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。

（九）本集合计划管理人于2023年10月27日披露金元证券尊享定制年年红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10月26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10月27日生效。

(十) 本集合计划管理人于2023年11月10日披露了金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划管理人自有资金拟参与的公告，管理人拟安排自有资金参与本集合计划，并以网站公告的形式向委托人征询意见。

(十一) 本集合计划管理人于2023年11月22日披露了金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划管理人自有资金参与的公告，管理人于2023年11月21日以自有资金3,400,000.00元参与本集合计划，参与份数为3,326,159.26份。本次自有资金参与后，本集合计划总份额为57,804,696.39份，其中管理人自有资金实际参与本集合计划的份额为6,926,321.26份，占集合计划总份额比例为11.98%，符合合同约定。

(十二) 本集合计划管理人于2023年12月13日披露了金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划管理人自有资金拟参与的公告，管理人拟安排自有资金参与本集合计划，并以网站公告的形式向委托人征询意见。

(十三) 本集合计划管理人于2023年12月25日披露了金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划管理人自有资金参与的公告，管理人于2023年12月22日以自有资金800,000.00元参与本集合计划，参与份数为776,171.53份。本次自有资金参与后，本集合计划总份额为64,717,723.04份，其中管理人自有资金实际参与本集合计划的份额为7,702,492.79份，占集合计划总份额比例为11.9%，符合合同约定。

## 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
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	上海前易信息咨询服务有限公司	公司子公司金元顺安基金管理有限公司另一股东
子、孙公司	金元期货股份有限公司	公司下属1级单位
	金元顺安基金管理有限公司	公司下属1级单位
	金元资本投资管理（深圳）有限公司	公司下属1级单位
	上海金元百利资产管理有限公司	公司下属2级单位
受同一母公司控制的其他企业	北京首都国际机场股份有限公司	集团下属1级单位
	天津滨海国际机场有限公司	集团下属1级单位
	天津市天航汽车运输有限公司	集团下属2级单位
	天津滨海国际航空物流有限公司	集团下属2级单位
	天津蓝海苑物业管理有限公司	集团下属2级单位
	江西省机场集团有限公司	集团下属1级单位
	江西省机场集团空港服务有限公司	集团下属2级单位
	江西民航置业有限公司	集团下属2级单位
	江西空港航空地面服务有限公司	集团下属2级单位
	南昌昌北国际机场有限公司	集团下属2级单位

	吉林省民航机场集团有限公司	集团下属1级单位
	吉林空港航空地面服务有限公司	集团下属2级单位
	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
	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
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

浙商银行股份有限公司关联方名单	
浙商银行股份有限公司	本公司
浙江省金融控股有限公司	持有我行股份 5%以上股东
浙江省能源集团有限公司	持有我行股份 5%以上股东
浙能资本投资(香港)有限公司	持有我行股份 5%以上股东



浙江能源国际有限公司	持有我行股份 5%以上股东
浙江恒逸集团有限公司	持有我行股份 5%以上股东
浙江恒逸石化有限公司	持有我行股份 5%以上股东
浙江恒逸高新材料有限公司	持有我行股份 5%以上股东
横店集团控股有限公司	持有我行股份 5%以上股东
浙江省海港投资运营集团有限公司	持有我行股份 5%以上股东
浙江海港（香港）有限公司	持有我行股份 5%以上股东
浙江浙银金融租赁股份有限公司	我行控股子公司
浙江中国轻纺城集团股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
绍兴中国轻纺城金融控股有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
永安期货股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙能资本控股有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州逸博投资管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
宁波恒逸贸易有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
海南逸盛石化有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州逸曝化纤有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。

福建逸锦化纤有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
宿迁逸达新材料有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
宿迁恒源热能有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
宿迁市汇达港务有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸聚合物有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸物流有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
绍兴恒逸物流有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
连云港俊博盛达物流有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
香港天逸国际控股有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
恒逸实业（文莱）有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
宁博恒奕工程管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
佳栢国际投资有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江巴陵恒逸己内酰胺有限责任	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理

公司	人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
海宁恒逸新材料有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
海宁俊博盛明贸易有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
海宁恒逸热电有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江逸盛新材料有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
广西恒逸新材料有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
广西恒逸环保科技有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
广西自贸区逸海港务有限责任公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江逸盛石化有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江逸昕化纤有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
广西恒逸顺琪贸易有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
上海恒逸聚酯纤维有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸石化销售有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。

浙江小逸供应链管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
海南恒憬贸易有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州逸通新材料有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州逸高环保科技有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸瀚霖企业管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
绍兴神工包装有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
恒逸石化股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
嘉兴逸鹏化纤有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
嘉兴恒屿贸易有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
太仓逸枫化纤有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江双兔新材料有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸工程管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸国际贸易有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。

	人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒凯能源有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸石化研究院有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州逸显能源科技有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州万永实业投资有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
香港逸天有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸能源有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州恒逸投资有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
上海恒逸纺织原料发展有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
广西恒逸化工贸易有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州锦绎实业有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州逸宸化纤有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江恒逸锦纶有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。

海南恒帆贸易有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州逸旭投资合伙企业（有限合伙）	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
东阳市横创实业发展合伙企业（有限合伙）	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店集团东磁股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店集团东磁有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
英洛华科技股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店集团得邦照明股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店集团英洛华电气有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江全方科技有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江新纳陶瓷新材有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店集团上海产业发展有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
普洛药业股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店集团家园化工有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。

	人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江横店影视城有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店影视股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江横店影视产权交易中心有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江横店体育发展有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
南华期货股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
东阳市金牛小额贷款有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江横店机场有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店影视娱乐有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江元景投资管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店集团浙江东磁房地产开发有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江横店得邦进出口有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
横店集团得邦工程塑料有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。

赣州市东磁稀土有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
金华合众汽车销售服务有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江横店九维艺术文化有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江省东阳市东磁诚基电子有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江海港资产管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
东海航运保险股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江海港产融投资管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江海港大宗商品交易中心有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州新安江千岛湖流域产业投资基金管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江玉皇山南投资管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
中国电子投资控股有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州创新金融研究院有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙商财产保险股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。



	人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
东方证券股份有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江富浙投资有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
杭州久胜私募基金管理有限公司	关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
常山县公信广告设计工作室	过去十二个月内关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
浙江红掌文化传播有限公司	过去十二个月内关联自然人直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除我行及我行子公司以外的法人。
香港中央结算(代理人)有限公司	前十大股东
太平人寿保险有限公司	前十大股东
山东省国际信托股份有限公司	前十大股东
民生人寿保险股份有限公司—自有资金	前十大股东
西子电梯集团有限公司	前十大股东
浙银理财有限责任公司	对外投资企业
杭州幸合投资有限公司	对外投资企业
中国银联股份有限公司	参股公司
国家融资担保基金有限责任公司	参股公司
旅行者汽车集团有限公司	股权关联关系
浙江永利实业集团有限公司	股权关联关系
通联资本管理有限公司	股权关联关系
财通证券股份有限公司	股权关联关系

浙江省能源集团财务有限责任公司	关联关系
浙江浙能融资租赁有限公司	关联关系
上海璞能融资租赁有限公司	关联关系
浙江浙石油综合能源销售有限公司	关联关系
杭州锦环投资有限公司	关联关系
浙能锦江环境控股有限公司	关联关系
浙江浙能中煤舟山煤电有限责任公司	关联关系
绍兴市柯桥区开发经营集团有限公司	关联关系
浙江永安资本管理有限公司	关联关系

## 十、备查文件目录

### （一）本集合计划备查文件目录

- 1、《金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划合同》
- 2、《金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划说明书》
- 3、《金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划风险揭示书》
- 4、《金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议》
- 5、《金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划说明书》（2023年10月）
- 6、《金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划风险揭示书》（2023年10月）
- 7、管理人业务资格批件、营业执照

### （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](http://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



## 承诺函

深圳证监局：

我公司承诺向贵局报送的电子版文件与纸质版原件完全一致，保证报送的文件真实、准确、完整，并愿意承担全部责任。



附件：2024年第一季度资产管理业务资产管理报告

