

金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划

2023年第三季度资产管理报告

(2023年7月1日-2023年9月30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、托管人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，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2023年10月27日复核了本报告的财务指标、净值表现、投资组合报告。

本报告未经审计。

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。

本报告期起止时间：2023年7月1日-2023年9月30日

一、集合资产管理计划概况

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：34,907,150.50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、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。

管理人：金元证券股份有限公司

托管人：浙商银行股份有限公司

信息披露网址：www.jyzq.cn

二、主要财务指标

(一) 主要财务指标

序号	主要财务指标	本期数
1	集合计划本期利润总额（元）	388,661.80
2	期末集合计划资产净值（元）	35,376,277.53
3	期末单位集合计划资产净值（元）	1.0134
4	期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.0134
5	本期集合计划净值增长率	1.1075%
6	集合计划累计净值增长率	1.3400%

(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

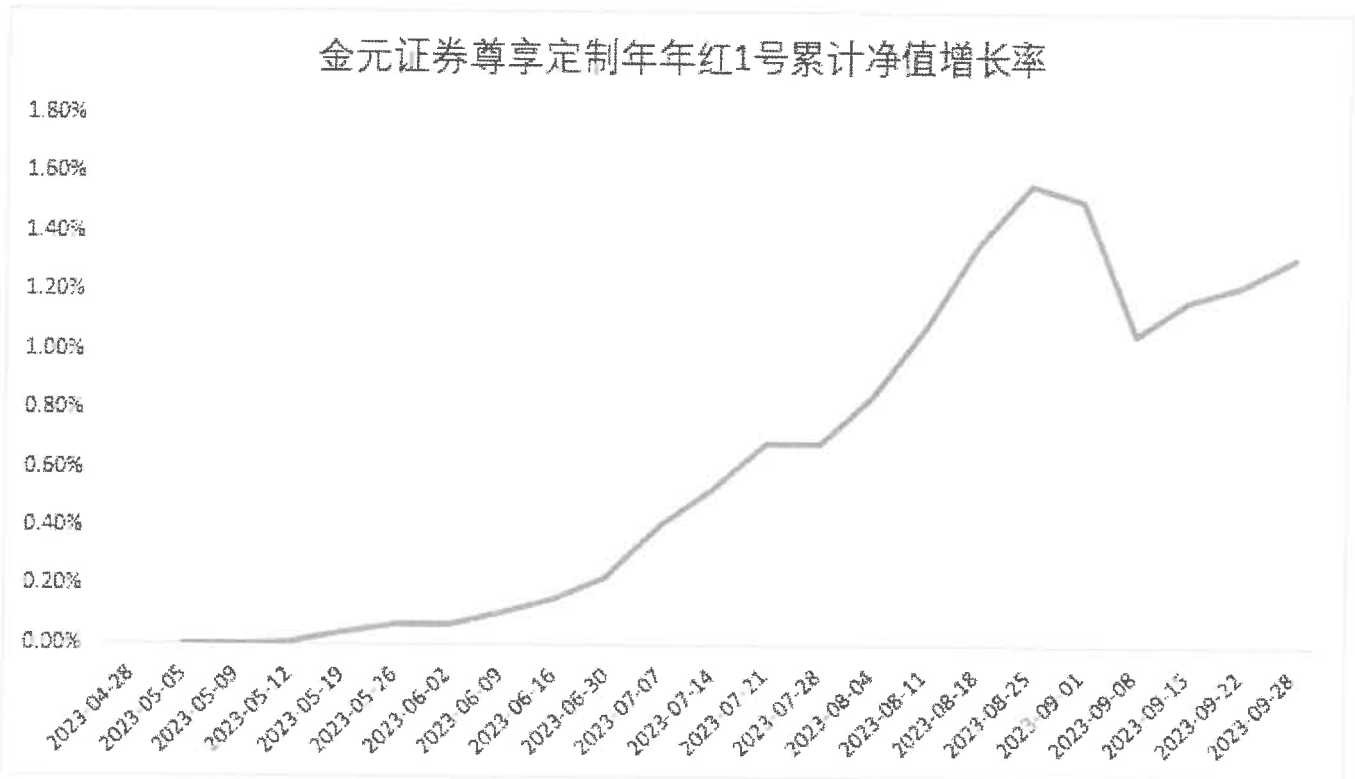
(三) 集合计划累计净值增长率变动情况

1、本计划历史各时间段净值增长率列表

阶段	累计净值增长率
过去三个月	1.1075%
本计划成立至今	1.3400%

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



三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至2023年9月30日，集合计划单位净值为1.0134元，累计单位净值为1.0134元。

(二) 投资经理简介

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）投资经理工作报告

1、行情回顾及运作分析

资金面：7月，资金整体平稳。8月，受地方债融资加速影响，资金利率整体上行。9月，受季末考核因素的影响，叠加税期和债券供给量较大，资金利率抬升幅度明显。

利率债：7月，债市经历了稳增长预期平稳、宽货币加码预期抬升、政治局会议落地后稳增长宽地产预期再发酵等几轮主线切换，长端利率先下后上。8月，长端品种月中受MLF下降的带动出现一波快速下行，短端利率债方面则主要受资金面收紧的影响总体呈现上行。9月，受“认房不认贷”政策放开、债券供给、跨季因素、美债问题的综合影响，利率债收益率持续上行。

信用债：7月，信用债收益率跟随长端利率债走势，先下后上。8月，受长端利率债强势的带动，信用债总体下行幅度明显，中央对于一揽子化债的表态以及地方再融资债券额度分配的传闻，市场城投信仰本月继续充值，前期收益率较高的天津、云南等地区一二级市场收益率本月显著下行。9月，受利率债收益率持续上行的影响，信用债同样出现了一定程度的利率上行，但因为信用债资产荒逻辑仍在延续，因此总体表现强于利率债。

产品运作：本季度，本计划在原有仓位的基础上，进一步加大了中等期限优质信用债资产的配置。

2、市场展望及投资策略

经过一系列经济刺激政策的出台，市场对于宏观经济的悲观情绪明显有所消解，困扰债券市场的矛盾由年中对于政策预期的不确定性变化为政策落地效果观点分化。我们将根据市场情况选择合适的投资策略，加强关注投资确定性

机会。

（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9月30日)

金额单位：元

资产	期末余额	上年年末余额	负债和所有者权益	期末余额	上年年末余额
资产：			负债：		
银行存款	112,983.94	0.00	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	445,930.71	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	2,944.69	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00	卖出回购金融资产款	14,605,640.00	0.00
交易性金融资产	49,490,504.83	0.00	应付清算款	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和垫款			应付管理人报酬	53,314.50	0.00
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	1,777.16	0.00
其他债权投资			应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应交税费	15,029.98	0.00
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	325.00	0.00
			负债合计	14,676,086.64	0.00
			所有者权益：		
			实收资金	34,907,150.50	0.00

			其他综合收益		
			未分配利润	469,127.03	0.00
			所有者权益合计	35,376,277.53	0.00
资产总计	50,052,364.17	0.00	负债和所有者权益总计	50,052,364.17	0.00

2、集合计划利润表（2023年7月1日-2023年9月30日）

金额单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	501,091.02	112,996.73
1. 利息收入	1,195.67	2,360.37
2. 投资收益（损失以“-”填列）	436,129.51	136,930.36
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）	63,765.84	-26,294.00
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	112,429.22	32,531.50
1. 管理人报酬	53,314.50	29,865.14
2. 托管费	1,777.16	995.51
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	55,872.69	986.30
其中：卖出回购金融资产利息支出	55,872.69	986.30
6. 信用减值损失	0.00	0.00

7. 税金及附加	1,464.87	284.55
8. 其他费用	0.00	400.00
三、利润总额	388,661.80	80,465.23
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润	388,661.80	80,465.23
五、其他综合收益	0.00	0.00
六、综合收益总额	388,661.80	80,465.23

(二) 集合计划投资组合报告

期末集合计划资产组合情况 (2023年9月30日)

金额单位：元

项目	期末市值	占总资产比例 (%)
银行存款和结算备付金	558,914.65	1.12
股票	0.00	0.00
债券	49,490,504.83	98.88
基金	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
买入返售证券	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00
其他资产	2,944.69	0.01
合计	50,052,364.17	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”等项。

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。

（三）集合计划份额的变动

单位：份

期初份额总额	34,907,150.50
报告期间总参与份额	0.00
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	34,907,150.50

五、集合计划的费用、业绩报酬

（一）管理人的管理费

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R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R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；

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、本计划终止日）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，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。

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。

在单个业绩报酬计算期间内，若产品年化收益高于或等于4.5%/年，则超过部分提取60%作为业绩报酬。

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。

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：

$$R = \frac{A - N}{N_0} + T \times 100\%$$

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 4.5% 的部分提取 60% 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
$R < 4.5\%$	0	$F = 0$
$R \geq 4.5\%$	60%	$F = (R - 4.5\%) \times C \times T \times 60\%$

其中：F 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 \times 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工作由管理人完成。管理人向托管人发送划付指令，托管人据此计提应付管理人业绩报酬，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。业绩报酬以管理人提供的数据为准，托管人据此进行账务处理，对业绩报酬金额不进行复核。

（二）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。

六、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、托管人办公地址没有发生变更。

(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) 本报告期内无新增关联方参与，截止2023年9月30日本集合计划关联方（公司员工鲍敏）持有300,013.5份，持有份额不变。

七、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说明书》

2、《金元证券尊享定制年年红1号集合资产管理计划合同》

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、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

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
二〇二三年十月二十七日