

# 金元证券金元鑫灏 1 号集合资产管理计划

## 2024 第二季度资产管理报告

(2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 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2024年7月15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：2024年4月1日-2024年6月30日

## 一、集合资产管理计划概况

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

到期日：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资产管理产品；

（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。

管理人：金元证券股份有限公司

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

序号	主要财务指标	本期数
1	集合计划本期利润总额（元）	-284,998.47
2	期末集合计划资产净值（元）	4,544,180.63
3	期末单位集合计划资产净值（元）	0.8328
4	期末单位集合计划累计资产净值（元）	0.9802
5	本期集合计划净值增长率	-5.9089%
6	集合计划累计净值增长率	-4.4717%

### (二) 集合计划累计净值增长率变动情况

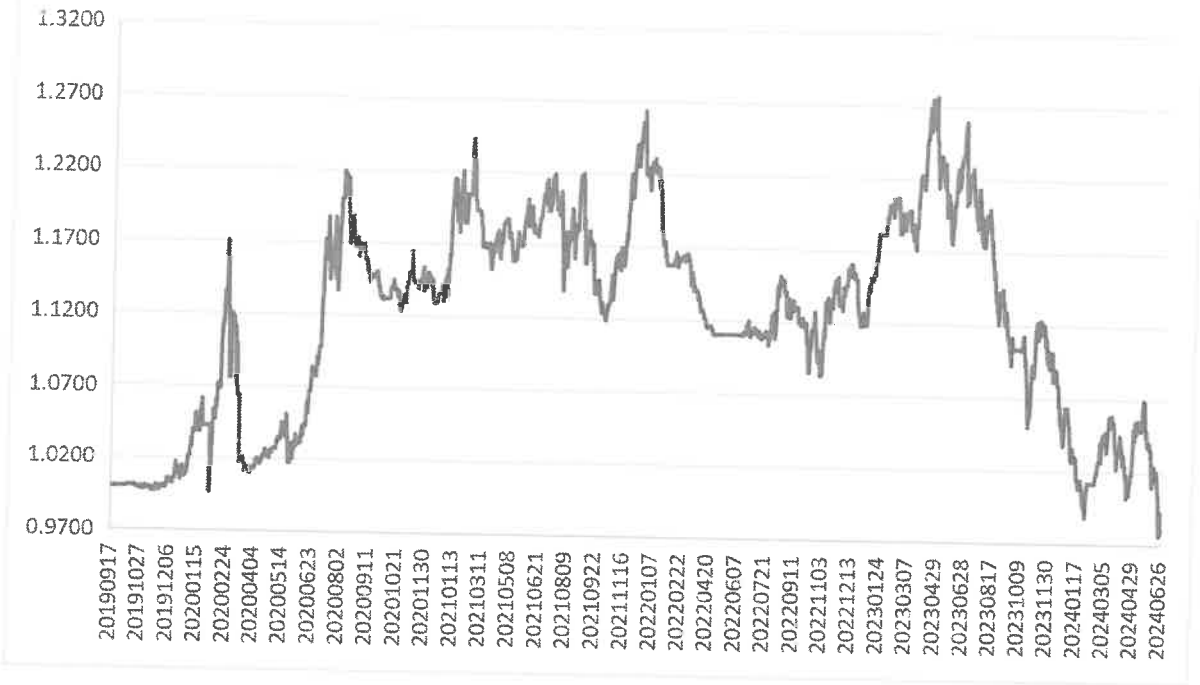
#### 1、本计划历史各时间段净值增长率列表

阶段	累计净值增长率
过去三个月	-5.9089%
本计划成立至本报告期末	-4.4717%

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

金元鑫灏1号累计单位净值历史走势图



### 三、集合计划管理人报告

#### (一) 业绩表现

截至2024年6月30日，集合计划单位净值为 0.8328元，累计单位净值为 0.9802元。

#### (二) 投资经理简介

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。

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）投资经理工作报告**

#### **1、行情回顾及运作分析**

2024年上半年证券市场比较动荡，两次进行3000点保卫战，上半年A股四大指数区间涨幅均为负，上证指数下跌0.25%，深证成指下跌7.10%，创业板指下跌10.99%，科创50指下跌16.42%，香港市场相对表现好些，恒生指数上涨3.94%，但恒生科技指数下跌5.57%。

2024年第二季度，沪指下跌1.44%，中小综指下跌5.66%，创业板指下跌7.68%，恒生科技指数上涨4.75%，市场成交量持续缩量低迷，除了高股息的少数公司，整体出现阴跌情况，少数活跃板块变动较快，投资主线经历了从涨价链、出口链到地产链、科特估的轮动。产品运作上，二季度产品仓位维持在70%左右，持有仓位主要集中在TMT、地产、电力和恒生科技板块。产品净值出现回调，回调幅度为5.22%。

#### **2、市场展望及投资策略**

2024年下半年市场有望从中特估部分转向科特估，由于美国降息可期，高股息公司的息差优势带来持续的投资价值，而波澜壮阔的科技革命浪潮有望推动中国人工智能在应用上例如无人驾驶等的蓬勃发展，科技的投资前景依然广阔。三中全会和美国大选后发展内需经济和科技自主可控会成为核心，具体上，新质生产力和能源是投资的重点方向，AI是新质生产力的重点，而AI的尽头是电力能源。

投资策略上，2024年三季度将根据市场节奏做好仓位和板块配置的管理，及时适时积极调整仓位和结构。主要关注两头，一方面是主题性投资机会的新质生产力方向，如智能交通、消费电子、机器人等细分行业；另一方面是低波红利板块，有快攻有稳守。行业配置上将以电力、资源、军工、TMT、高股息高分红和低估值修复核心品种为主要投资方向。操作上注意等待和把握板块的轮动节奏，

---

尤其是耐心等待情绪充分释放后的超跌反弹机会以及适当对高位的品种进行止盈，适度的高低切换，积小胜为大胜，关注价值成长板块，回归价值投资。

#### **（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、集合计划财务报告**

#### **（一）集合计划会计报告书**

# 1、集合计划资产负债表（2024年6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
<b>资 产：</b>			<b>负 债：</b>		
银行存款	400.33	584.19	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.00	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	33,463.65	1,103,902.74	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	0.00	0.00
交易性金融资产	4,526,688.67	3,893,097.26	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	0.00	0.00	应付管理人报酬	11,992.31	12,958.56
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	599.71	647.95
其他债权投资	0.00	0.00	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	0.00	0.00
应收股利	0.00	15,333.80	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	3,780.00	0.00
			<b>负债合计</b>	16,372.02	13,606.51
			<b>所有者权益：</b>		
			实收资金	5,456,285.08	5,456,285.08
			其他综合收益	0.00	0.00
			未分配利润	-912,104.45	-456,973.60
			<b>所有者权益合计</b>	4,544,180.63	4,999,311.48
<b>资产总计</b>	4,560,552.65	5,012,917.99	<b>负债和所有者权益总计</b>	4,560,552.65	5,012,917.99

## 2、集合计划利润表（2024年4月1日-2024年6月30日）

金额单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	-267,406.45	-157,551.58
1. 利息收入	285.05	803.92
2. 投资收益（损失以“-”填列）	113,323.84	-366,854.32
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）	-381,015.34	208,498.82
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	17,592.02	12,580.80
1. 管理人报酬	11,992.31	11,981.73
2. 托管费	599.71	599.07
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	0.00	0.00
8. 其他费用	5,000.00	0.00
三、利润总额	-284,998.47	-170,132.38
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润	-284,998.47	-170,132.38
五、其他综合收益	0.00	0.00
六、综合收益总额	-284,998.47	-170,132.38



## (二) 集合计划投资组合报告

期末集合计划资产组合情况 (2024年6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	400.33	0.01
股票	2,197,828.97	48.19
债券	0.00	0.00
基金	2,328,859.70	51.07
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	33,463.65	0.73
合计	4,560,552.65	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。

## (三) 集合计划份额的变动

单位：份

期初份额总额	5,456,285.08
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	5,456,285.08

## 五、集合计划的费用、业绩报酬

### (一) 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。

### (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0.05%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。

### (三) 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：

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

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。

## 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) 本集合计划于 2024 年 4 月 25 日披露了《关于金元鑫灏 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更的公告》，管理人就本次合同变更事项以网站公告的形式向委托人征询意见。

(七) 本集合计划于 2024 年 4 月 26 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》，本集合计划原投资经理为杨宜霏及陈勇，自 2024 年 4 月 29 日起陈勇不再担任本集合计划投资经理，本集合计划投资经理变更为杨宜霏女士及梁乐健先生共同担任。

(八) 本集合计划于 2024 年 5 月 8 日披露了《关于金元鑫灏 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更生效的公告》，合同变更征询意见期结束，本集合计划合同变更事项于 2024 年 5 月 8 日生效。

## 七、关联方关系

### (一) 管理人金元证券股份有限公司关联方名单

关联方名称/姓名	关系	
首都机场集团有限公司	母公司	
安徽国耀创业投资管理有限公司	公司独立董事任职企业	
厦门国家会计学院		
北京市康达（深圳）律师事务所		
海口市财金投资管理有限公司		
安徽厚殖资产管理有限公司	公司的关联自然人直接或者间接控制的，或者由关联自然人担任董事、高级管理人员的除公司及其控股子公司以外的法人或其他组织	
安徽地康宝农业科技有限公司		
深圳汇金泰富投资有限公司		
合肥云通物联科技有限公司		
安庆市东翔化工原料有限责任公司		
芜湖金财典当有限责任公司		
航投私募基金管理有限公司		
银河基金管理有限公司		
上海前易信息咨询服务有限公司		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
金元期货股份有限公司		子、孙公司
金元顺安基金管理有限公司		
金元资本投资管理（深圳）有限公司		
上海金元百利资产管理有限公司		
北京首都国际机场股份有限公司	受同一母公司控制的其他企业	
天津滨海国际机场有限公司		

天津市天航汽车运输有限公司	
天津滨海国际航空物流有限公司	
天津蓝海苑物业管理有限公司	
江西省机场集团有限公司	
江西省机场集团空港服务有限公司	
江西民航置业有限公司	
江西空港航空地面服务有限公司	
南昌昌北国际机场有限公司	
吉林省民航机场集团有限公司	
吉林空港航空地面服务有限公司	
长春龙嘉国际机场有限公司	
吉林省大地绿化工程有限公司	
吉林省空港航空服务有限责任公司	
吉林省强华房地产开发有限公司	
吉林省翔云航空服务有限责任公司	
首都机场临空发展集团有限公司	
三亚首地兴业置业有限公司	
深圳市优地房地产开发有限公司	
北京首地兴业置业有限公司	
重庆首地房地产开发有限公司	
武汉首地兴业房地产开发有限公司	
吉林省首地房地产开发有限公司	
湖北首地房地产开发有限公司	
内蒙古首地房地产开发有限公司	
三亚（首都机场）投资开发有限公司	
三亚（首都机场）物业管理有限公司	
江西首地置业有限公司	

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

北京首都机场动力能源有限公司	
北京首都机场节能技术服务有限公司	
北京中鹏饮料水有限公司	
北京首都机场航空安保有限公司	
北京空港赛瑞安防科技有限公司	
首都机场集团财务有限公司	
首都机场集团商务航空管理有限公司	
首都公务机有限公司	
首都机场集团资产管理有限公司	
深圳市新方汇达投资发展有限公司	
深圳市凯美豪盛酒店物业管理有限公司	
北京信通大厦有限公司	
航港金控投资有限公司	
荆州长江城市建设发展投资有限公司	
北京大兴国际机场航空食品有限公司	
北京首新航空地面服务有限公司	
北京民航机场巴士有限公司	
北京空港开远客运有限公司	
北京空港兴航达客运有限公司	
北京兴航达客运服务有限公司	
北京空港通力客运场站经营有限公司	
北京通力联合汽车维修有限公司	
北京民航安乐出租汽车有限责任公司	
首都机场集团设备运维管理有限公司	
北京博维航空设施管理有限公司	
首都机场集团科技管理有限公司	



北京创联民航技术有限公司		
北京司拓民航科技有限责任公司		
北京金飞民航经济发展有限公司		
瑞海姆田园度假村有限公司		
北京京瑞房产有限公司		
深圳市润隆乐华投资有限公司	对公司施加重大影响的投资方	
佛山市乐华恒业实业投资有限公司		
佛山市霍陈贸易有限公司		
江苏东方盛虹股份有限公司		
江苏盛虹科技股份有限公司		
江苏盛虹新材料集团有限公司		
盛虹（苏州）集团有限公司		
广州市黄埔龙之泉实业有限公司		
广州市龙的投资股份有限公司		
海口市创新产业投资有限公司		
海口市国有资产经营有限公司		
海口市城市建设投资集团有限公司		
厦门科华伟业股份有限公司		
陆涛		公司关键管理人员
郭长洲		
付华杰		
林怀宇		
张俊		
陈爱华		
向南		
王鸿武		
谢敏敏		

卜巍巍	
吴毓锋	
王晖	
云琳	
田原	
方琛	
沈兰成	

## (二) 托管人中国光大银行股份有限公司北京分行关联方名单

关联方名称/姓名	关系
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
中国中信金融资产管理股份有限公司	补充前十名股东, 中国华融资产管理股份有限公司已更名为中国中信金融资产管理股份有限公司
中国投资有限责任公司	补充实际控制人
中国证券金融股份有限公司	补充前十名股东
香港中央结算（代理人）有限公司	补充前十名股东
香港中央结算有限公司	补充前十名股东
申万宏源集团股份有限公司	年报披露光大集团控参股的其他境内外上市公司
中国海运（集团）总公司	年报披露股权关系
中央汇金投资有限责任公司	年报披露股权关系
CEL Elite Limited	年报披露关联方
郑州欧安乐龄护理院	年报披露关联方
光大水务（青岛）有限公司	年报披露关联方
北京中青旅创格科技有限公司	年报披露关联方
光大证券国际控股有限公司	年报披露关联方
Prospect Well Investment Limited	年报披露关联方
海发宝诚融资租赁有限公司	年报披露关联方
中远海运发展（香港）有限公司	年报披露关联方
光大环保能源（济南）有限公司	年报披露关联方

中国信达资产管理股份有限公司	年报披露关联方
中国光大证券国际有限公司	年报披露关联方
上海光大证券资产管理有限公司	年报披露关联方
光大永明资产管理股份有限公司	年报披露关联方
光大保德信基金管理有限公司	年报披露关联方
北京华恒兴业房地产开发有限公司	年报披露关联方
北京华恒业房地产开发有限公司	年报披露关联方
东方证券股份有限公司	中国光大银行股份有限公司关联交易公告 20240308
中国太平洋财产保险股份有限公司	年报披露关联方，中国光大银行股份有限公司关联交易公告 20240327
华荃有限公司	年报披露关联方，中国光大银行股份有限公司关联交易公告 20240308

## 八、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、《金元证券金元鑫灏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）
- 17、《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五》
- 18、《金元鑫灏1号集合资产管理计划说明书》（2024年4月更新）
- 19、《金元鑫灏1号集合资产管理计划风险揭示书》（2024年4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](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  
二〇二四年七月二十九日