

申万宏源金利六号集合资产管理计划

2023 年度报告

重要提示

本报告由申万宏源金利六号集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）管理人申万宏源证券资产管理有限公司（以下称“申万宏源证券资管”）编制，本集合计划托管人已复核了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。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性。

托管人认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本年度报告相关财务资料已经审计。

本报告期起止时间：2023年01月01日—2023年12月31日

一、集合计划概况

产品名称：	申万宏源金利六号集合资产管理计划
产品类型：	固定收益类集合资产管理计划
成立日期：	2020年03月17日
到期日期：	2028年03月17日
存续期：	8年
管理人：	申万宏源证券资产管理有限公司
托管人：	兴业银行股份有限公司
注册登记机构：	申万宏源证券资产管理有限公司

二、集合计划管理人履职报告

(一) 集合计划投资经理简介

徐可为，毕业于美国密歇根州立大学，硕士学位。曾任职于申银万国证券股份有限公司资产管理事业部，2015年至2023年9月就职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部，2023年10月至今就职于申万宏源证券资产管理有限公司，历任产品经理、交易员、投资经理助理，现任投资经理。目前担任申万宏源金利系列、丰盈金利系列、信聚稳健系列等产品投资主办人。

该投资经理不存在其他兼职情况，已取得投资经理执业证书，证书编号为：S0900817090003，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000003405，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

傅晶晶，毕业于香港科技大学，取得会计学硕士学位，2017年9月至2023年9月，就职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部，2023年10月至今就职于申万宏源证券资产管理有限公司，任投资经理。历任债券交易员、投资经理助理，现任投资经理，参与了稳聚系列集合产品及多个定向产品投资交易工作。

该投资经理已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002638，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历，不存在其他兼职情况。

符亦然，毕业于英国伯明翰大学，理学硕士，曾担任中原证券自营投资部交易员，2017年5月至2023年9月，就职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部。2023年10月至今就职于申万宏源证券资产管理有限公司，任投资经理。目前担任申万宏源金利系列、建盈金利系列、丰盈金利系列、申利短债系列、信聚稳健短债系列、丰收短债系列产品的投资主办人，具有多年资产管理工作经验。不存在其他兼职情况。该投资经理已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002687，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

（二）集合计划投资经理工作报告

（1）投资运作情况回顾

回顾来看，2023年债券利率整体明显下行，细分来看，利率中超长端表现亮眼，30年国债表现突出，30年国债从年初的3.2%左右下行到年末的2.8%左右，下行36.6bp。信用中城投受到化债政策推动，信用利差在理财赎回风波过后明显压缩，3年AA城投债收益率从年初的4.15%左右下行至年末3.0%左右，下行超过100bp。

（2）市场展望和投资策略

展望2024年，明确一点，我们认为债券市场牛市结束的核心体现是曲线走陡，曲线走陡方式，可以是央行超预期大幅度下调短期利率，并切实降低实际利率，激发居民部门的信贷需求，改善经济预期，从而导致短端下行幅度超过长端；也可以是出现了货币政策之外的刺激因素，明显改善市场参与者的经济增长预期，从而导致长端上行。简而言之，即“曲线不陡，牛市不走”。因此，总的来看，我们认为当前利率下行虽猛，但仍难言趋势结束，整体的久期与杠杆不应过于保守，不过由于30年等超长端已经混入了不少纯债以外市场参与者，隐含的波动已经不大适合纯债投资者继续重仓参与，聚焦10年国开，长期限高等级信用等具有相对利差保护，且投资者风偏较为类似的品种可能是更好的策略选择。

（三）集合计划运作合规性声明

本报告期内，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、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，在严格控制风险的基础上，为计划持有人谋求最大利益。本计划运作合法合规，无损害计划持有人利益的行为，本计划的投资管理符合有关法规的规定。

（四）风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人根据监管要求及公司整体的风险偏好、风险容忍度、风险限额等开展资产管理业务，并通过设立独立的风险控制部门对业务开展过程中的有关风险进行监测，定期或不定期向公司层级的风险管理部门进行风险控制报告。投资经理对所管理产品的持仓风险进行识别和分析，对所发现的风险信息向部门负责人及风险控制部门报告，若涉及信用风险的同步向信评部门报告。公司层级的风险管理部门将资产管理业务纳入公司整体风险管理框架，对资产管理业务风险进行独立再监控，对资产管理业务中存在的与监管要求及公司风险政策、风险偏好、风险容忍度、风险限额不符的情况进行风险揭示，并向公司领导进行风险控制报告。

三、集合计划托管人履职情况

托管人已对本集合计划出具了《年度托管报告》，报告期托管人履职报告详见附件《年度托管报告》。

四、集合计划投资报告

（一）本集合计划业绩表现

截止2023年12月31日，集合计划单位净值为1.0879元，累计单位净值为1.1366元，报告期内累计净值增长率为3.81%，单位净值增长率为3.99%。

注1：累计净值增长率的计算公式如下：累计净值增长率=累计单位净值（期末/期初）-1 不跨期 期初=报告开始日-1 跨期=成立日

注2：本期单位基金净值增长率的计算公式如下：本期单位基金净值增长率=（本期第一次分红或扩募前单位基金资产净值÷期初单位基金资产净值）×（本期第二次分红或扩募前单位基金资产净值÷本期第一次分红或扩募后单位基金资产净值）×……×（期末单位基金资产净值÷本期最后一次分红或扩募后单位基金资产净值）-1

（二）主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年01月01日—2023年12月31日）
--------	------------------------------

1. 本期已实现收益	11,044,223.41
2. 本期利润	14,603,529.56
3. 期末资产净值	208,668,809.72
4. 期末资产总值	209,084,495.44
5. 期末单位净值	1.0879
6. 期末单位累计净值	1.1366

注1: 本期已实现收益指本集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

注2: 所述业绩指标不包括持有人认购及赎回费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(三) 管理人提取业绩报酬情况

本报告期内提取业绩报酬465,498.06元。

五、集合计划投资组合报告(截止 2023 年 12 月 31 日)

(一) 资产组合情况

单位: 元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	1,048,949.91	0.50%
结算备付金	0.00	0.00%
存出保证金	0.00	0.00%
证券清算款	0.00	0.00%
应收申购款	0.00	0.00%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	114,874,864.50	54.94%
权证投资	0.00	0.00%
基金投资	98.61	0.00%
买入返售金融资产	93,160,582.42	44.56%
其他资产	0.00	0.00%
合计	209,084,495.44	100%

注1: “其他资产”包括、“应收红利”、“应收利息”、“其他应收款”等项目。

注2: 因四舍五入, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

(二) 股票持仓前五名明细

证券代码	证券名称	数量(股)	市值(元)	占资产净值比例
无	无	无	无	无

(三) 债券持仓前五名明细

证券代码	证券名称	数量(份)	市值(元)	占资产净值比例
112304020.IB	23中国银行CD020	200,000.00	19,745,782.68	9.46%
177635.SH	21宜国投	100,000.00	10,632,523.29	5.10%
178197.SH	21洋口01	100,000.00	10,480,452.06	5.02%
042380187.IB	23腾海投资CP002	100,000.00	10,364,218.58	4.97%
032100562.IB	21亳州交投PPN001	100,000.00	10,316,366.12	4.94%

(四) 基金持仓前五名明细

证券代码	证券名称	数量(份)	市值(元)	占资产净值比例
005309.OTC	中银证券汇嘉定期开放 债券	88.39	98.61	0.00%

六、集合计划运用杠杆情况

(1) 本报告期内期初杠杆率为3.08%，期末杠杆率为0.00%，报告期内杠杆率控制符合《产品合同》的约定。其中，杠杆率等于正回购市值金额除以净资产市值金额。

(2) 本产品投资不涉及股指期货。

(3) 本产品投资不涉及国债期货。

七、集合计划财务会计报告

(一) 资产负债表（报告截止日：2023年12月31日）

单位：元

资产	期末余额 2023年12月31日	上年年末余额 2022年12月31日	负债和净资产	期末余额 2023年12月31日	上年年末余额 2022年12月31日
资产：			负债：		
货币资金	1,048,949.91	33,618.60	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.00	877,707.01	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	0.00	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	0.00	11,007,474.26
应收清算款	0.00	0.00	应付管理人报酬	344,322.75	718,235.44
应收利息	0.00	0.00	应付托管费	13,772.93	28,729.42
应收股利	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
买入返售金融资产	93,160,582.42	47,239,299.28	应交税费	46,798.35	116,014.47
发放贷款和垫款	0.00	0.00	应付清算款	0.00	0.00
交易性金融资产	114,874,963.11	321,101,788.91	应付赎回款	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他权益工具投资	0.00	0.00	其他负债	10,791.69	17,206.71
长期股权投资	0.00	0.00	负债合计	415,685.72	11,887,660.30
其他资产	0.00	0.00	净资产：		
			实收资金	191,806,336.85	341,570,597.43
			其他综合收益	0.00	0.00
			未分配利润	16,862,472.87	15,794,156.07
			净资产合计	208,668,809.72	357,364,753.50
资产总计：	209,084,495.44	369,252,413.80	负债和净资产总计：	209,084,495.44	369,252,413.80

截至资产负债表日，本产品暂估业绩报酬前的资产净值208,668,809.72元，该净值未体现暂估业绩报酬 266,570.07 元，暂估业绩报酬后的资产净值 208,402,239.65 。暂估业绩报酬为假设本产品于本报告期末清算，根据本产品至该日止的收益情况估算的业绩报酬。由于本产品存在业绩波动的可能性，该暂估金额仅供参考，与实际需要产品持有人承担的管理人业绩报酬可能存在差异。

(二) 利润表（本报告期：2023年01月01日—2023年12月31日）

单位：元

项目	本期金额 2023年01月01日—2023年12月31日	上期金额 2022年01月01日—2022年12月31日
一、营业总收入	17,216,915.98	14,556,343.78
利息收入	4,140,835.55	5,739,008.87
投资收益（损失以“-”填列）	9,516,774.28	12,386,977.41

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
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	3,559,306.15	-3,569,642.50
汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
其他业务收入	0.00	0.00
二、营业总支出	2,613,386.42	3,039,369.73
管理人报酬	2,394,281.85	2,689,984.32
其中：暂估管理人报酬	0.00	0.00
托管费	77,151.31	98,120.98
销售服务费	0.00	0.00
投资顾问费	0.00	0.00
利息支出	41,013.62	143,143.55
信用减值损失	0.00	0.00
税金及附加	36,460.08	43,683.09
其他费用	64,479.56	64,437.79
三、利润总额	14,603,529.56	11,516,974.05
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	14,603,529.56	11,516,974.05
五、其他综合收益的税后净额	0.00	0.00
六、综合收益总额	14,603,529.56	11,516,974.05

（三）净资产变动表（本报告期：2023年01月01日—2023年12月31日）

单位：元

项目	本期金额 2023年01月01日—2023年12月31日				上年金额 2022年01月01日—2022年12月31日			
	实收资金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计	实收资金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上年年末余额	341,570,597.4 3	0.00	15,794,156.0 7	357,364,753. 50	216,347,075. 44	0.00	3,992,785.91	220,339,861. 35
加：会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
二、本年初余额	341,570,597.4 3	0.00	15,794,156.0 7	357,364,753. 50	216,347,075. 44	0.00	3,992,785.91	220,339,861. 35
三、本年增减变动额（减少以“-”号填列）	-149,764,260. 58	0.00	1,068,316.80	-148,695,943 .78	125,223,521. 99	0.00	11,801,370.1 6	137,024,892. 15
（一）综合收益总额	0.00	0.00	14,603,529.5 6	14,603,529.5 6	0.00	0.00	11,516,974.0 5	11,516,974.0 5
（二）产品持有人申购和赎回	-149,764,260. 58	0.00	-13,535,212. 76	-163,299,473 .34	125,223,521. 99	0.00	284,396.11	125,507,918. 10
其中：产品申购	701,647,892.1 9	0.00	45,332,107.8 1	746,980,000. 00	1,866,616,46 0.07	0.00	67,638,539.9 3	1,934,255,00 0.00
产品赎回	-851,412,152. 77	0.00	-58,867,320. 57	-910,279,473 .34	-1,741,392,9 38.08	0.00	-67,354,143. 82	-1,808,747,0 81.90

(三) 利润分配	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(四) 其他综合收益结转 留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
四、本年年末余额	191,806,336.8 5	0.00	16,862,472.8 7	208,668,809. 72	341,570,597. 43	0.00	15,794,156.0 7	357,364,753. 50

八、报表附注

(一) 财务报表的编制基础

本资产管理计划的财务报表以持续经营为编制基础。本资产管理计划的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、财政部印发的《资产管理产品相关会计处理规定》和中国证券监督管理委员会、中国证券投资基金业协会允许的资产管理行业实务操作的有关规定编制。本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本资产管理计划2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净值变动情况。

(二) 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，按照财政部颁布的企业会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券监督管理委员会发布和修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证券监督管理委员会、中国证券投资基金业协会发布的关于资产管理行业实务操作的有关规定以及《申万宏源金利六号集合资产管理计划资产管理合同》的相关约定。

(三) 重要会计政策和会计估计

1、金融资产分类，初始确认和后续计量

本资产管理计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，金融资产以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产，相关交易费用计入初始确认金额。

(1) 以摊余成本计量的金融资产

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本资产管理计划将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。

本资产管理计划对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入，按摊余成本进行后续计量，其发生减值时或终止确认、修改产生的利得或损失，计入当期损益。

本资产管理计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本资产管理计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本资产管理计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本资产管理计划按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本资产管理计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本资产管理计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产条件均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。

本资产管理计划对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

2、金融资产的终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确

认条件的，金融资产将终止确认。

本资产管理计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本资产管理计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

3、金融负债分类，初始确认和后续计量

金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。在初始确认时，金融负债以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。

4、金融负债的终止确认

如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

(四) 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明。

本资产管理计划本期无重大会计政策和会计估计变更。

(五) 报表重要项目的说明

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日
第一层次	98.61
第二层次	114,874,864.5
第三层次	0.0
合计	114,874,963.11

(六) 或有和承诺事项、资产负债表日后非调整事项

截至资产负债表日，本资产管理计划无需要披露的或有和承诺事项。

截至财务报表批准日，本资产管理计划无需要披露的资产负债表日后事项。

(七) 关联方关系及其交易

1、关联方关系及交易性质

关联方	关系	交易性质
申万宏源证券资产管理有限公司	计划管理人	提取管理费 提取业绩报酬
兴业银行股份有限公司	计划托管人	提取托管费
申万宏源证券有限公司	计划管理人的股东	收取佣金

2、通过关联方席位交易情况

股票、基金、债券、债券回购交易情况：

关联方	交易金额	占总交易量比例
-----	------	---------

申万宏源证券有限公司	5,634,779,667.69	100%
------------	------------------	------

(八) 与金融工具相关的流动性风险、信用风险、市场风险的信息

1、流动性风险

资产管理计划不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险可以分为以下几种：

(1) 市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对资产管理计划造成不利影响。

(2) 证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，从而使得资产管理计划在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。

(3) 资产管理计划中的资产不能应付可能出现的投资者退出的风险。

(4) 如资产管理计划封闭运作，在资产管理计划的存续期内，投资者不能退出本资产管理计划，对投资者存在流动性风险。

(5) 受限于资产管理计划投资标的可能存在的流动性风险，进而导致资产管理计划委托财产无法及时变现，对投资者存在流动性风险。

2、信用风险

因融资方、交易对手或发行人的信用承担、履约能力发生变化导致未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者未能按时履约的风险。

3、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致市场变量变化产生的风险，其中市场变量包括但不限于利率、汇率、股票价格和商品价格等。市场风险主要包括：

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

(3) 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使资产管理计划收益水平随之发生变化，从而产生风险。

(4) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致资产管理计划投资收益变化。

(5) 购买力风险

投资者的收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

(九) 侧袋机制相关情况

本资产管理计划未启用侧袋机制。

九、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

1、集合计划管理费

本集合计划管理费由固定管理费及管理人业绩报酬组成，管理人业绩报酬计算方式具体见本节第（四）条约定。

固定年管理费率为0.5%。按前一日资产净值计算，逐日计提，按季支付。在每个季度结束后的次月的前5个工作日内，由管

理人向托管人发送集合计划固定管理费划付指令，托管人复核后从集合计划中支付给管理人。若遇非工作日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。固定管理费计算方法如下：

$$M=i \times \text{固定年管理费率} \div 365$$

M为每日应计提的固定管理费，i为前一日的集合计划资产净值。

本集合计划存续期间，管理人/托管人有权直接调低固定管理费率/托管费率，固定管理费率/托管费率的调低经管理人公告即生效。

③ 证券交易费用

集合计划投资运作期间发生的交易佣金、开放式基金的认（申）购和赎回费、基金公司认（申）购和赎回费、印花税作为交易成本直接扣除。交易佣金的费率由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格和法律法规确定。

2、集合计划托管费

年托管费率为0.02%。按前一日资产净值计算，逐日计提，按季支付。在每个季度结束后的次月的前5个工作日内，由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划中支付给托管人。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。托管人收取托管费账户如下：户名：证券公司客户资产管理计划托管业务收入 托管费账户：21620019 1675 0001 46开户银行：兴业银行上海分行营业部 托管费计算方法如下： $C=i \times \text{年托管费率} \div 365$ C为每日应计提的托管费，i为前一日的集合计划资产净值

3、集合计划业绩报酬

管理人将在业绩报酬计提日针对委托人每笔份额分别核算其业绩报酬核算期，并根据《产品合同》业绩报酬条款约定计提业绩报酬。

十、集合计划投资收益分配情况

报告期内，本资管计划未进行收益分配。

十一、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

- 1、报告期内本资管计划投资经理未发生变更。
- 2、本报告期内本计划未发生重大关联交易。

交易对手	交易标的	买入/卖出	交易数量	交易金额	交易时间	关联关系
-	-	-	-	-	-	-

3、本报告期内本计划未发生一般关联交易。

交易对手	交易标的	买入/卖出	交易数量	交易金额	交易时间	关联关系
-	-	-	-	-	-	-

4、本产品非FOF产品，不涉及FOF产品相关信息披露。

5、本报告期内已报告的重大事项

根据中国证券监督管理委员会《关于核准申万宏源证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2022]2615号），中国证监会已核准申万宏源证券有限公司（以下简称“证券公司”）通过设立申万宏源证券资产管理有限公司从事证券资产管理业务，并核准证券公司自身减少证券资产管理业务。

申万宏源证券资产管理有限公司（以下简称“资管子公司”）已完成工商注册登记并取得营业执照，并已于2023年9月28日实际取得中国证券监督管理委员会颁发的《经营证券期货业务许可证》，自2023年10月9日起，本计划平移至资管子公司运作管理，即本计划管理人由“申万宏源证券有限公司”变更为“申万宏源证券资产管理有限公司”，资产管理合同及托管

协议（如有）项下管理人的权利和义务由资管子公司承继，并由其履行管理人职责。

管理人于本报告期内在管理人网站披露了《申万宏源证券有限公司关联方公告》、《申万宏源金利六号集合资产管理计划新增销售机构的公告》、《关于申万宏源金利六号集合资产管理计划管理人主体变更事宜的公告》、《申万宏源证券资产管理有限公司关联方公告》及《关于申万宏源证券资产管理有限公司集合资产管理计划账户变更的公告》。

十三、其他信息披露事项

1、截止本报告期末，本集合计划不涉及非标资产投资，具体投资情况如下：

标的类型	项目名称	净值（元）	占资产净值比例
无	无	无	无

十二、信息披露的查阅方式

网址：www.swhyzcg1.com

信息披露电话：95523/4008895523

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人申万宏源证券资产管理有限公司。

管理人：申万宏源证券资产管理有限公司

2024年03月19日