

## 申万宏源金利六号集合资产管理计划

### 2023 年第 3 季度报告

#### 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、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。

本季度报告相关财务资料未经审计。

本季度报告报告期间：2023年07月01日—2023年09月30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：	固收
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、工行代销丰盈金利系列、蚂蚁财富代销短债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、建行代销建盈金利系列、工行代销丰盈金利系列、交行委外申利短债系列、蚂蚁财富代销短债系列、浙江省联社 BOF 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。该投资经理已取得投资主办人执业证书，证书编号为：S0900817120003，并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

三季度债券市场表现总体震荡，尽管 6-7 月经济数据低于预期，但 6 月央行超预期降息后，政策进一步加码的预期难以证伪，利率没有走出二季度的顺畅下行行情。在 8 月底印花税减免、一线城市落地认房不认贷等强有力政策出台后，叠加资金面持续偏紧，利率转而上行。截至 9 月 28 日，10 年国债利率活跃券收于 2.67%，较季初上行 3bp。总体来看，三季度信用表现强于利率，中长端表现好于短端。具体来看，国内经济也显示触底迹象且在缓慢修复中。房地产、出口以及基建都有所起色，作为基建和房地产重要表征变量的螺纹钢表观需求，体现出缓慢恢复的态势，背后对应于基建支撑；此前大中城市商品房成交面积震荡下行的趋势得到遏止，目前来看有望恢复到一定水平，后续可能为上下游行业需求带来一定的增量；进出口情况也边际修复较快，虽然绝对数值仍不理想，但趋势上已出现改善。

### （2）市场展望和投资策略

展望四季度，对债券市场持中性态度，一方面需要看到经济仍在边际改善，政策持呵护态度，经济底已经非常明显，这在中期的方向上对债券偏不利，但另一方面也要看到债券市场已经出现不小的调整，赔率已经显现，如果后续汇率压力缓解，资金面可能有额外惊喜，也不宜对债券市场过度悲观，建议保持中性久期，侧重中短端，抓住高票息资产的确定性机会。

## （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、风险限额等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《季度托管报告》，报告期托管人履职报告详见附件《季度托管报告》。

## 四、集合计划投资报告

### （一）本集合计划业绩表现

截止 2023 年 09 月 30 日，集合计划单位净值为 1.0782 元，累计单位净值为 1.1269 元，报告期内累计净值增长率为 0.7%，单位净值增长率为 0.73%。

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07月01日—2023年09月30日)
1. 本期已实现收益	2,423,927.84
2. 本期利润	2,777,810.19
3. 期末资产净值	353,189,677.99
4. 期末资产总值	356,007,920.99
5. 期末单位净值	1.0782
6. 期末单位累计净值	1.1269

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(申)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146,486.37元。

## 五、集合计划投资组合报告(截止2023年09月30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	341,003.03	0.10%
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	187,317,521.83	52.62%
权证投资	0.00	0.00%
基金投资	97.94	0.00%
买入返售金融资产	168,349,298.19	47.29%
其他资产	0.00	0.00%
合计	356,007,920.99	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	19,619,315.57	5.55%
032000877.IB	20九江富和PPN001	100,000.00	10,481,602.74	2.97%
114850.SZ	20泉港03	100,000.00	10,468,109.59	2.96%
177635.SH	21宜国投	100,000.00	10,442,649.32	2.96%
133351.SZ	22世园D1	100,000.00	10,406,547.95	2.95%

### (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	88.39	97.94	0.00%

	债券		
--	----	--	--

## 六、集合计划运用杠杆情况

(1) 本报告期内期初杠杆率为0.00%，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、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：2162 0019 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。

## 八、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。

## 九、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。
- 3、本报告期内本计划未发生一般关联交易。
- 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，本计划将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将由资管子公司承继，并由其履行管理人职责。

管理人于本报告期内在管理人官网披露了《申万宏源证券有限公司关联方公告》。

#### 十、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

#### 十一、信息披露的查阅方式

网址：[www.swhysc.com/swhyzg](http://www.swhysc.com/swhyzg)

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

2023年10月24日