

交银理财稳享固收精选日开 1 号（7 天持有期）理财产品定期报告（2023 年第一季度）

尊敬的客户：

我司交银理财稳享固收精选日开 1 号（7 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000921000053）

2023 年第一季度定期报告公告如下：

报告期为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日。

一、资产组合情况

1.1 期末直接/间接投资资产分布。

投资资产分类	直接	间接	合计
现金	0.96%	5.20%	6.16%
债权类资产	25.03%	65.33%	90.36%
权益类资产	0.00%	3.48%	3.48%
商品及金融衍生品类	0.00%	0.00%	0.00%
合计	25.99%	74.01%	100.00%

1.2 期末穿透后前十大资产明细。

序号	资产名称	规模（万元）	占比
1	活期存款	385,814.77	6.16%
2	2023 年记账式付息(一期)国债	100,550.07	1.61%
3	债券买入返售	86,863.17	1.39%
4	2020 年记账式付息(九期)国债	78,628.90	1.26%
5	1003 他行存款	72,878.15	1.16%
6	2022 年记账式付息(二十三期)国债	57,267.96	0.91%
7	1003 他行存款	56,260.89	0.90%
8	1003 他行存款	55,460.68	0.89%
9	LCTYCF 广东华兴银行 1Y220607001	51,076.11	0.82%
10	建信短债债券型证券投资基金	50,380.21	0.80%
合计		995,180.91	15.89%

1.3 期末非标准化债权类资产明细。

报告期末，本产品不持有非标准化债权类资产。

1.4 报告期间非标准化债权类资产收益情况。

报告期内，本产品无非标准化债权类资产收益分配情况。

二、报告期间关联交易发生情况

2.1 产品投资关联方发行、承销的证券的情况。

报告期内，本产品未投资于关联方发行、承销的证券。

2.2 产品投资关联方发行的资产管理产品情况。

序号	资产名称	累计发生金额 (万元)	交易类型	关联方名称
1	交银国信汇利 200 号集合资金信托计划	24,000.00	资产买入	交银国际信托有限公司
2	交银稳鑫短债债券 A	9,999.90	资产买入	交银施罗德基金管理有限公司
3	交银裕隆纯债债券 A	9,999.95	资产买入	交银施罗德基金管理有限公司
4	交银国信汇利 200 号集合资金信托计划	106,637.61	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司
5	交银国信·汇利 275 号集合资金信托计划	101.86	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司
6	交银国信·汇利 273 号集合资金信托计划	102.49	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司

2.3 产品向关联方支付的费用。

序号	费用类型	累计发生金额 (万元)	关联方名称
1	托管费	319.17	交通银行股份有限公司
2	投资管理费	1,211.47	交银理财有限责任公司
3	销售手续费	724.02	交通银行股份有限公司

2.4 产品发生的其他关联交易。

报告期内，本产品未发生其他关联交易。

2.5 报告期末产品持有或通过资管产品持有的关联方发行、承销的证券。

序	证券名称	持有金额	关联方名称
---	------	------	-------

号		(万元)	
1	上饶市国有资产经营集团有限公司 2022年度第一期超短期融资券	110.60	交通银行股份有限公司
2	滁州市同创建设投资有限公司 2022年度第三期超短期融资券	151.57	交通银行股份有限公司
3	淮南建设发展控股(集团)有限公司 2022年度第一期超短期融资券	309.79	交通银行股份有限公司
4	广西投资集团有限公司 2022 年度第 三期超短期融资券	577.29	交通银行股份有限公司
5	镇江城市建设产业集团有限公司 2022 年度第七期超短期融资券	43.18	交通银行股份有限公司
6	西安高新控股有限公司 2022 年度第 三期超短期融资券	454.10	交通银行股份有限公司
7	新疆可克达拉市国有资本投资运营 有限责任公司 2022 年度第二期超短 期融资券	0.51	交通银行股份有限公司
8	伊犁哈萨克自治州财通国有资产经 营有限责任公司 2022 年度第三期超 短期融资券	0.51	交通银行股份有限公司
9	伊犁哈萨克自治州财通国有资产经 营有限责任公司 2022 年度第四期超 短期融资券	0.76	交通银行股份有限公司
10	国家电网有限公司 2022 年度第十四 期超短期融资券	55.94	交通银行股份有限公司
11	青岛胶州城市发展投资有限公司 2023 年度第一期超短期融资券	3,865.86	交通银行股份有限公司
12	上饶市国有资产经营集团有限公司 2023 年度第一期超短期融资券	2,902.83	交通银行股份有限公司
13	郑州航空港兴港投资集团有限公司 2020 年度第三期定向债务融资工具	1,496.81	交通银行股份有限公司
14	衡阳市城市建设投资有限公司 2020 年度第三期定向债务融资工具	22.51	交通银行股份有限公司
15	20 岳阳城建 PPN001	1,210.49	交通银行股份有限公司
16	青岛海洋投资集团有限公司 2020 年 度第一期定向债务融资工具	1,502.34	交通银行股份有限公司
17	衡阳市城市建设投资有限公司 2020 年度第四期定向债务融资工具	207.88	交通银行股份有限公司

18	20 青岛城投 PPN001	597.47	交通银行股份有限公司
19	21 西海发展 PPN001	1.78	交通银行股份有限公司
20	临沂投资发展集团有限公司 2021 年度第一期定向债务融资工具	614.21	交通银行股份有限公司
21	南充发展投资(控股)有限责任公司 2021 年度第二期定向债务融资工具	73.66	交通银行股份有限公司
22	青岛西海岸发展(集团)有限公司 2021 年度第三期定向债务融资工具	0.77	交通银行股份有限公司
23	湖北荆门城建集团有限公司 2021 年度第二期定向债务融资工具	47.24	交通银行股份有限公司
24	重庆市涪陵国有资产投资经营集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	56.04	交通银行股份有限公司
25	孝感市城市建设投资公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	21.85	交通银行股份有限公司
26	青岛西海岸新区海洋控股集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	2,346.16	交通银行股份有限公司
27	如东县开泰城建投资有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	332.93	交通银行股份有限公司
28	杭州余杭创新投资有限公司 2022 年度第三期定向债务融资工具	583.67	交通银行股份有限公司
29	杭州余杭城市发展投资集团有限公司 2022 年度第六期定向债务融资工具	296.53	交通银行股份有限公司
30	常德市城市建设投资集团有限公司 2023 年度第三期定向债务融资工具 (品种一)	10.96	交通银行股份有限公司
31	常德市城市建设投资集团有限公司 2023 年度第五期定向债务融资工具	21.91	交通银行股份有限公司
32	桐庐县国有资产投资经营有限公司 2022 年度第一期短期融资券	217.64	交通银行股份有限公司
33	泉州台商投资区开发建设有限责任公司 2022 年度第一期短期融资券	86.15	交通银行股份有限公司
34	洛阳城市发展投资集团有限公司 2022 年度第一期短期融资券	129.22	交通银行股份有限公司

35	盐城市交通投资建设控股集团有限公司 2023 年度第一期短期融资券	4,776.73	交通银行股份有限公司
36	乐山国有资产投资运营(集团)有限公司 2023 年度第二期短期融资券	54.25	交通银行股份有限公司
37	弘创融资租赁有限公司 2020 年度第二期资产支持票据优先 A2 级	1.84	交通银行股份有限公司
38	华电金泰(北京)投资基金管理有限公司 2022 年度第一期交享粤响定向资产支持票据优先级	58.01	交通银行股份有限公司
39	深圳前海桂金融资租赁有限公司 2022 年度第一期资产支持票据优先 A1 档	13.85	交通银行股份有限公司
40	18 渝水投 MTN001	55.96	交通银行股份有限公司
41	衡阳市城市建设投资有限公司 2018 年度第三期中期票据	314.81	交通银行股份有限公司
42	19 陕延油 MTN012	487.94	交通银行股份有限公司
43	荆州市城市建设投资开发有限公司 2020 年度第三期中期票据	22.39	交通银行股份有限公司
44	自贡市城市建设投资开发集团有限公司 2020 年度第一期中期票据	36.94	交通银行股份有限公司
45	山西晋城无烟煤矿业集团有限责任公司 2020 年度第十二期中期票据	175.84	交通银行股份有限公司
46	河钢集团有限公司 2020 年度第十期中期票据	0.52	交通银行股份有限公司
47	20 曲文投 MTN001	136.33	交通银行股份有限公司
48	中交第二航务工程局有限公司 2020 年度第一期中期票据	549.18	交通银行股份有限公司
49	武汉临空港投资集团有限公司 2020 年度第三期中期票据	199.54	交通银行股份有限公司
50	中交第四公路工程局有限公司 2020 年度第一期中期票据(品种二)	109.90	交通银行股份有限公司
51	湖北省长江产业投资集团有限公司 2020 年度第三期中期票据	198.58	交通银行股份有限公司
52	南通高新技术产业开发区总公司 2021 年度第一期中期票据	33.09	交通银行股份有限公司

53	中航国际租赁有限公司 2021 年度第四期中期票据	78.45	交通银行股份有限公司
54	青岛西海岸新区融合控股集团有限公司 2021 年度第二期中期票据	910.53	交通银行股份有限公司
55	河钢集团有限公司 2021 年度第二期中期票据	200.17	交通银行股份有限公司
56	青岛国信发展(集团)有限责任公司 2021 年度第四期中期票据	196.51	交通银行股份有限公司
57	中交第四公路工程局有限公司 2022 年度第一期中期票据(品种二)	588.22	交通银行股份有限公司
58	淄博市城市资产运营有限公司 2022 年度第四期中期票据	1,991.65	交通银行股份有限公司
59	山东恒邦冶炼股份有限公司 2022 年度第二期中期票据	190.75	交通银行股份有限公司
60	衡阳市城市建设投资有限公司 2022 年度第四期中期票据	172.17	交通银行股份有限公司
61	贵州交通建设集团有限公司 2022 年度第五期中期票据	875.02	交通银行股份有限公司
62	建安投资控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	150.71	交通银行股份有限公司
63	珠海华发集团有限公司 2021 年度第一期绿色中期票据(碳中和债)	106.12	交通银行股份有限公司
64	恒丰银行股份有限公司 2020 年无固定期限资本债券	10,754.78	交通银行股份有限公司
65	中国工商银行股份有限公司 2021 年二级资本债券(第一期)	4.43	交通银行股份有限公司
66	深圳市前海融通商业保理有限公司 2021 年度第一期定向资产支持票据 优先级	6,956.79	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
67	中国信达资产管理股份有限公司 2021 年无固定期限资本债券(第一期)	595.31	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
68	19 杭州银行二级	85.70	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
69	20 中国银行二级 01	0.79	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司

70	中国银行股份有限公司 2021 年二级 资本债券(第一期)(品种一)	2.59	交通银行股份有限公司、招商银行股 份有限公司
----	---------------------------------------	------	---------------------------

三、投资运作分析

3.1 基本情况。

产品名称	交银理财稳享固收精选日开 1 号（7 天持有期）理财产品			
报告期末产 品份额总额	56,308,668,125.22			
报告期末产 品资产净值 （万元）	5,965,712.18			
期末杠杆水 平	105.04%			
下属产品份 额的销售名 称	下属产品份 额的销售代 码	报告期末下属产品 份额的总份额	报告期末 下属产品 份额的单 位净值	报告期末下 属产品份额 的累计单位 净值
交银理财稳 享固收精选 日开 1 号（7 天持有期） 理财产品	5811221014	55,221,973,143.81	1.0598	1.0598
交银理财稳 享固收精选 日开 1 号（7 天持有期） 理财产品 B	5811221087	1,019,712,921.56	1.0404	1.0404
交银理财稳 享固收精选 日开 1 号（7 天持有期） 理财产品 C	5811222111	66,982,059.85	1.0100	1.0100

3.2 流动性风险分析。

产品高流动性资产比例超过 5%，七日可变现资产超过 10%，符合监管要求。产品杠杆水平较低，可变现资产能满足开

放期申赎需求，流动性风险很低。

四、未来展望

2023年一季度，我国GDP同比增速4.5%，出口和金融数据均超预期，工业、消费数据等表现一般。资金方面，利率中枢抬升，资金分层现象有所缓和。债市经历了去年四季度的大幅下跌，在“弱现实+强预期”的组合下，一季度走出了估值修复的债牛行情，理财端负债逐步修复，加速推动债市收益率下行，信用利差显著压缩，信用债表现优于利率债。海外市场方面，欧美银行业出现危机，基本面数据进一步放缓，通胀预期反弹，发达市场利率企稳回升，权益、大宗表现优于国债。

展望二季度，经历了一季度信用利差的显著修复，当前债券资产估值水平回归到一个相对中性的位置。但短期不论从基本面演绎、通胀走势、还是投资者对于海外金融风险以及美国经济衰退的担忧，均会抑制无风险利率的上行空间。二季度宏观政策方面，预计财政政策相对平稳，货币政策保持稳健且精准有力。债券市场中，有安全边际的中短端票息策略仍占优，利率波动仍取决于流动性充裕程度和资金面的稳定性，持续关注经济的持续性和修复的斜率，延续对债市窄幅震荡判断。

策略上，产品将继续维持高等级短久期票息策略，严控集中度和个券风险。保持现金管理增强的定位，在保证流动性的基础上，以精选短久期资产为主，灵活运用组合杠杆策略，保持组合合理久期，熨平组合收益波动，严控净值回撤，争取成为客户短期理财的优选产品。

我司保留对以上所有文字说明的最终解释权。

感谢您一直以来对我司的支持！

特此公告。

交银理财有限责任公司

2023 年 4 月 21 日