

交银理财稳享固收精选日开 2 号（60 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 2 号（60 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000921000175）

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	5.01%	1.61%	6.62%
债权类资产	18.86%	67.31%	86.17%
权益类资产	0.00%	7.21%	7.21%
商品及金融衍生品类	0.00%	0.00%	0.00%
合计	23.87%	76.13%	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	136,277.76	6.62%
2	2020 年记账式付息(九期)国债	66,182.61	3.22%
3	债券买入返售	50,011.58	2.43%
4	1003 他行存款	48,895.75	2.38%
5	2022 年记账式付息(十四期)国债	45,563.71	2.21%
6	1003 他行存款	33,467.95	1.63%
7	债券买入返售	32,022.40	1.56%
8	1003 他行存款	25,593.71	1.24%
9	农行优 1	24,337.94	1.18%
10	中行优 3	24,231.36	1.18%
合计		486,584.76	23.64%

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	交银施罗德资管卓远 1 号集合资管计划	8,100.00	资产买入	交银施罗德资产管理有限公司
2	交银国信·汇利 275 号集合资金信托计划	35,000.00	资产买入	交银国际信托有限公司
3	交银施罗德资管卓远 2 号集合资产管理计划	9,800.00	资产买入	交银施罗德资产管理有限公司
4	交银国信汇利 200 号集合资金信托计划	3,000.00	资产买入	交银国际信托有限公司
5	交银国信汇利 200 号集合资金信托计划	128,425.80	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	113.29	交通银行股份有限公司
2	投资管理费	408.66	交银理财有限责任公司
3	销售手续费	468.06	交通银行股份有限公司

2.4 产品发生的其他关联交易。

序号	资产名称	累计发生金额(万元)	交易类型	关联方名称
1	21 碧地 03	2,397.15	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司

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。

序号	证券名称	持有金额 (万元)	关联方名称
----	------	--------------	-------

1	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	1,260.19	交通银行股份有限公司
2	20 岳阳城建 PPN001	1,019.13	交通银行股份有限公司
3	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	1,264.84	交通银行股份有限公司
4	20 青岛城投 PPN001	503.02	交通银行股份有限公司
5	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	517.12	交通银行股份有限公司
6	洛阳城乡建设投资集团有限公司 2021 年度第二期定向债务融资工具	915.60	交通银行股份有限公司
7	临沂投资发展集团有限公司 2021 年度第二期定向债务融资工具(革 命老区)	90.76	交通银行股份有限公司
8	洛阳城乡建设投资集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	234.62	交通银行股份有限公司
9	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	1,975.27	交通银行股份有限公司
10	中远海运租赁有限公司 2022 年度 第一期定向债务融资工具	457.07	交通银行股份有限公司
11	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	491.40	交通银行股份有限公司
12	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	249.65	交通银行股份有限公司
13	天津城市基础设施建设投资集团有 限公司 2022 年度第十期短期融资 券	144.42	交通银行股份有限公司
14	18 渝水投 MTN001	214.74	交通银行股份有限公司
15	19 武水务 MTN001	49.26	交通银行股份有限公司
16	重庆市水利投资(集团)有限公司 2019 年度第一期中期票据	7.84	交通银行股份有限公司
17	19 陕延油 MTN012	1,405.43	交通银行股份有限公司

18	20 曲文投 MTN001	523.11	交通银行股份有限公司
19	中交第二航务工程局有限公司 2020 年度第一期中期票据	2,380.42	交通银行股份有限公司
20	广西广投能源集团有限公司 2020 年度第二期中期票据	523.19	交通银行股份有限公司
21	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)	786.16	交通银行股份有限公司
22	陕西金融控股集团有限公司 2021 年度第一期中期票据	180.53	交通银行股份有限公司
23	上海新世界(集团)有限公司 2021 年度第一期中期票据	463.08	交通银行股份有限公司
24	中航国际租赁有限公司 2021 年度第四期中期票据	184.28	交通银行股份有限公司
25	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	766.59	交通银行股份有限公司
26	陕西投资集团有限公司 2021 年度第六期中期票据	533.04	交通银行股份有限公司
27	北方凌云工业集团有限公司 2021 年度第一期中期票据	7.73	交通银行股份有限公司
28	青岛国信发展(集团)有限责任公司 2021 年度第四期中期票据	413.32	交通银行股份有限公司
29	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)	495.23	交通银行股份有限公司
30	淄博市城市资产运营有限公司 2022 年度第四期中期票据	1,676.80	交通银行股份有限公司
31	平安国际融资租赁有限公司 2022 年度第一期中期票据	235.24	交通银行股份有限公司
32	武汉金融控股(集团)有限公司 2022 年度第二期中期票据	242.50	交通银行股份有限公司
33	广西铁路投资集团有限公司 2022 年度第五期中期票据	236.47	交通银行股份有限公司
34	贵州交通建设集团有限公司 2022 年度第五期中期票据	736.70	交通银行股份有限公司
35	建安投资控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	126.88	交通银行股份有限公司
36	19 工商银行永续债	20.94	交通银行股份有限公司

37	20 工商银行二级 01	49.68	交通银行股份有限公司
38	20 中国银行永续债 02	1,487.41	交通银行股份有限公司
39	中国工商银行股份有限公司 2020 年二级资本债券(第二期)(品种一)	33.77	交通银行股份有限公司
40	恒丰银行股份有限公司 2020 年无固定期限资本债券	9,054.62	交通银行股份有限公司
41	中国工商银行股份有限公司 2021 年二级资本债券(第一期)	38.70	交通银行股份有限公司
42	2021 年中信银行股份有限公司无固定期限资本债券	2.65	交通银行股份有限公司
43	兴业银行股份有限公司 2021 年第二期二级资本债券(品种一)	1,623.66	交通银行股份有限公司
44	兴业银行股份有限公司 2022 年第一期二级资本债券	479.15	交通银行股份有限公司
45	中国工商银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第二期)(品种一)	290.18	交通银行股份有限公司
46	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	5,857.03	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
47	中国三峡新能源(集团)股份有限公司 2021 年度第二期绿色资产支持票据(碳中和债)	275.07	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
48	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)	501.20	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
49	兴业银行股份有限公司 2019 年第二期二级资本债券	7.77	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
50	20 中国银行永续债 01	1,099.71	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
51	20 农业银行永续债 01	36.23	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
52	20 中信银行二级	12.99	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司

			限公司
53	20 中国银行二级 01	49.70	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
54	中国银行股份有限公司 2021 年二级资本债券(第一期)(品种一)	7.69	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
55	中国银行股份有限公司 2021 年无固定期限资本债券(第二期)	269.76	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
56	中国邮政储蓄银行股份有限公司 2022 年无固定期限资本债券(第一期)	318.14	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 2 号（60 天持有期）理财产品			
报告期末产品份额总额	18,088,647,228.82			
报告期末产品资产净值（万元）	1,903,236.89			
期末杠杆水平	108.12%			
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 2 号（60 天持有期）理财产品	5811221046	16,305,784,434.37	1.0533	1.0533
交银理财稳享固收精选日开 2 号私银尊享（60 天持有	5811221097	1,181,789,059.30	1.0435	1.0435

期)理财产品				
交银理财稳享 固收精选日开 2号(60天持 有期)理财产品 C	5811221104	601,073,735.15	1.0375	1.0375

以上产品资产净值、份额净值、累计净值均未扣除当期暂估的超额业绩报酬。

3.2 流动性风险分析。

本产品严格遵守监管流动性要求，并保持适度杠杆和久期操作，配置相应比例流动性较好的高等级债券，保证产品有充足的流动性应对客户赎回。

四、未来展望

展望二季度，经济持续复苏，政策以稳为主，利率或先上后下，10年国债区间看2.8-3.0。当前10年国债在2.85%的点位已接近震荡区间的下限。二季度是新老政府的政策接棒期，也是外需回落、政策扩内需的阶段，通常这个阶段社融表现不会太差，从近期呵护民企、对外来开放等信号来看新班子对于经济增长的诉求可能比市场想象更强，4、5月经济预计仍能保持较强的向上动能，市场尚未合理定价复苏中经济基本面，债市环境逆风，但由于基本面的利空因素已经被市场预期，利率上行幅度有限，2.95仍然是个强阻力位。6月之后，政策拉动作用减弱，社融增速或后继乏力，而伴随美联5月可能的最后一次加息落地，货币政策有再度宽松的预期，利率或重新打开下行空间。综合来看，利率先上后下，但幅度都有限，总体维持震荡格局，地产修复预期差、资金面波动则是主导二季度债市波动的关键要素。

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