

交银理财稳享固收精选日日开理财产品定期报告 (2023 年第一季度)

尊敬的客户：

我司交银理财稳享固收精选日日开理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000922000064）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	1.20%	0.38%	1.58%
债权类资产	13.55%	84.87%	98.42%
权益类资产	0.00%	0.00%	0.00%
商品及金融衍生品类	0.00%	0.00%	0.00%
合计	14.75%	85.25%	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	1003 他行存款	196,711.29	3.69%
2	1003 他行存款	196,711.29	3.69%
3	1003 他行存款	147,593.29	2.77%
4	2022 年记账式付息(五期)国债	116,210.23	2.18%
5	债券买入返售	99,260.09	1.86%
6	1003 他行存款	96,896.12	1.82%
7	债券买入返售	88,976.00	1.67%
8	活期存款	84,246.26	1.58%
9	1003 他行存款	77,626.88	1.45%
10	1003 他行存款	70,531.02	1.32%
合计		1,174,762.47	22.01%

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 273 号集合资金信托计划	3,729.87	资产买入	交银国际信托有限公司
2	交银国信·汇利 273 号集合资金信托计划	61,813.37	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	314.76	交通银行股份有限公司
2	投资管理费	644.80	交银理财有限责任公司
3	销售手续费	297.25	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。

报告期末，本产品不持有、亦不通过资产管理产品持有关联方发行或承销的证券。

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日开理财产品
报告期末产品份额总额	49,597,738,196.76
报告期末产品资产净值	5,085,232.05

(万元)				
期末杠杆水平	104.96%			
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日开理财产品	5811222044	46,966,010,502.04	1.0254	1.0254
交银理财稳享固收精选日日开理财产品 B	5811222046	2,347,879,008.32	1.0240	1.0240
交银理财稳享固收精选日日开理财产品 C	5811222147	283,848,686.40	1.0081	1.0081

3.2 流动性风险分析。

产品高流动性资产比例持续高于 5%监管要求，整体杠杆水平仍有空间，资产变现能力较高。产品流动性风险较低。

四、未来展望

从宏观经济基本面来看，宏观经济呈现疫情后复苏态势，结构分化显著。旅游、餐饮等服务消费随消费场景恢复而强劲回升、地产销售回暖带动部分后周期商品消费改善，但汽车等大宗消费表现较弱，地产销售回暖向投资传导不畅。从货币政策来看，流动性预计保持合理充裕，以支持经济修复。从财政政策来看，预计中性略积极，投资可能继续发力，维持必要的财政支出。

综上，中短期内，债券风险相对可控，我们认为债券市场或呈现震荡态势。投资团队将持续关注宏观经济基本面、货币和财政政策、境内外风险因素等，灵活调整持仓，争取创造更好的收益表现。

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