

交银理财稳享灵动慧利日开 1 号（180 天持有期）理财产品定期报告（2023 年第一季度）

尊敬的客户：

我司交银理财稳享灵动慧利日开 1 号（180 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000921000376）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	0.98%	0.60%	1.58%
债权类资产	12.46%	85.96%	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	13.44%	86.56%	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	126,704.73	2.60%
2	1003 他行存款	101,507.60	2.08%
3	LCTYCF 武汉农村商业银行 6M221130001	100,948.89	2.07%
4	活期存款	77,080.17	1.58%
5	2022 年记账式付息(十四期)国债	76,445.77	1.57%
6	1003 他行存款	75,971.84	1.56%
7	1003 他行存款	75,927.21	1.56%
8	2020 年记账式付息(九期)国债	60,073.36	1.23%
9	1003 他行存款	50,729.34	1.04%
10	1003 他行存款	50,618.14	1.04%
合计		796,007.05	16.32%

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 220 号集合资金信托计划	11,000.00	资产买入	交银国际信托有限公司
2	交银国信·汇利 220 号集合资金信托计划	65,271.89	资产卖出 或到期	交银国际信托有限公司
3	交银国信·汇利 201 号集合资金信托计划	91,862.92	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	373.65	交通银行股份有限公司
2	投资管理费	1,995.72	交银理财有限责任公司
3	销售手续费	596.92	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。

序号	证券名称	持有金额 (万元)	关联方名称
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	4,582.00	交通银行股份有限公司
2	青岛军民融合发展集团有限公司 2023 年度第一期超短期融资券	1,046.71	交通银行股份有限公司
3	新郑新区发展投资有限责任公司 2019 年度第一期定向债务融资工具	707.77	交通银行股份有限公司
4	新郑新区发展投资有限责任公司 2020 年度第一期定向债务融资工具	767.92	交通银行股份有限公司
5	20 淮安水利 PPN002	764.68	交通银行股份有限

			公司
6	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	208.30	交通银行股份有限公司
7	20 株洲城建 PPN002	3,610.91	交通银行股份有限公司
8	20 长春城投 PPN001	1,904.85	交通银行股份有限公司
9	21 岳阳城建 PPN001	377.36	交通银行股份有限公司
10	21 济南城建 PPN001	1,120.49	交通银行股份有限公司
11	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	607.54	交通银行股份有限公司
12	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	389.66	交通银行股份有限公司
13	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	518.51	交通银行股份有限公司
14	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	1,050.68	交通银行股份有限公司
15	邯郸市交通投资集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	2,822.67	交通银行股份有限公司
16	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	202.18	交通银行股份有限公司
17	九江市国有投资控股集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	748.77	交通银行股份有限公司
18	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	3,281.57	交通银行股份有限公司
19	新疆维吾尔自治区国有资产投资经营有限责任公司 2022 年度第二期定向债务融资工具	355.43	交通银行股份有限公司
20	滁州市同创建设投资有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具	385.58	交通银行股份有限公司
21	青岛市即墨区城市开发投资有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具	1,778.50	交通银行股份有限公司
22	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	101.38	交通银行股份有限公司

	(品种一)		
23	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	202.75	交通银行股份有限公司
24	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	501.99	交通银行股份有限公司
25	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	17.04	交通银行股份有限公司
26	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	4.66	交通银行股份有限公司
27	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 A2 档	347.74	交通银行股份有限公司
28	重庆市水利投资(集团)有限公司 2019 年度第一期中期票据	651.64	交通银行股份有限公司
29	蚌埠市城市投资控股有限公司 2019 年度第一期中期票据	1,155.90	交通银行股份有限公司
30	20 景国资 MTN001	4,383.21	交通银行股份有限公司
31	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	207.20	交通银行股份有限公司
32	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	304.64	交通银行股份有限公司
33	20 淮安国投 MTN001	2,151.94	交通银行股份有限公司
34	20 湖北科投 MTN001	1,097.79	交通银行股份有限公司
35	武汉临空港投资集团有限公司 2020 年度第三期中期票据	3,258.54	交通银行股份有限公司
36	广西广投能源集团有限公司 2020 年度第二期中期票据	406.79	交通银行股份有限公司
37	南通高新技术产业开发区总公司 2021 年度第一期中期票据	306.19	交通银行股份有限公司
38	江苏宜兴经济开发区投资发展有限 公司 2021 年度第一期中期票据	2,198.38	交通银行股份有限公司
39	淄博市城市资产运营有限公司 2021 年度第一期中期票据	2,146.39	交通银行股份有限公司
40	洛阳城市发展投资集团有限公司	1,071.40	交通股份有限

	2021 年度第二期中期票据		公司
41	陕西投资集团有限公司 2021 年度第六期中期票据	414.44	交通银行股份有限公司
42	北方凌云工业集团有限公司 2021 年度第一期中期票据	507.57	交通银行股份有限公司
43	青岛国信发展(集团)有限责任公司 2021 年度第四期中期票据	321.36	交通银行股份有限公司
44	清远市德晟投资集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	2,121.11	交通银行股份有限公司
45	广西投资集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	3,546.03	交通银行股份有限公司
46	吉林省高速公路集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	1,808.80	交通银行股份有限公司
47	建安投资控股集团有限公司 2022 年度第二期中期票据	2,125.95	交通银行股份有限公司
48	广西铁路投资集团有限公司 2022 年度第五期中期票据	1,058.98	交通银行股份有限公司
49	衡阳市城市建设投资有限公司 2022 年度第四期中期票据	1,485.73	交通银行股份有限公司
50	建安投资控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	720.12	交通银行股份有限公司
51	19 工商银行永续债	16,069.10	交通银行股份有限公司
52	华融湘江银行股份有限公司 2020 年无固定期限资本债券	21,926.52	交通银行股份有限公司
53	齐鲁银行股份有限公司 2020 年无固定期限资本债券	10,011.44	交通银行股份有限公司
54	20 工商银行二级 01	8,028.11	交通银行股份有限公司
55	恒丰银行股份有限公司 2020 年无固定期限资本债券	17,361.33	交通银行股份有限公司
56	齐鲁银行股份有限公司 2021 年无固定期限资本债券	1,755.43	交通银行股份有限公司
57	恒丰银行股份有限公司 2021 年无固定期限资本债券	4,873.08	交通银行股份有限公司
58	2021 年第一期成都农村商业银行股份有限公司二级资本债券	10,435.99	交通银行股份有限公司
59	兴业银行股份有限公司 2021 年第	891.96	交通银行股份有限

	一期二级资本债券		公司
60	兴业银行股份有限公司 2021 年第二期二级资本债券(品种一)	882.16	交通银行股份有限公司
61	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)	213.87	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
62	2018 年中国华融资产管理股份有限公司二级资本债券	7,128.61	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
63	中国信达资产管理股份有限公司 2022 年无固定期限资本债券(第一期)	3,796.20	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
64	中交一公局集团有限公司 2022 年度第一期中期票据(可持续挂钩/科创票据)	1,048.78	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
65	兴业银行股份有限公司 2019 年第一期二级资本债券	275.34	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
66	江苏银行股份有限公司 2020 年无固定期限资本债券	45,616.59	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
67	20 华融湘江二级 01	11,232.93	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
68	20 华融租赁债 01	10,919.41	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
69	20 中国银行永续债 01	45,451.22	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
70	上海浦东发展银行股份有限公司 2020 年无固定期限资本债券	6,220.92	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	交银理财稳享灵动慧利日开 1 号（180 天持有期）理财产品
------	--------------------------------

报告期末产品 份额总额	41,210,706,664.36			
报告期末产品 资产净值 (万元)	4,266,364.77			
期末杠杆水平	114.30%			
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 灵动慧利日开 1号(180天持 有期)理财产品	5811221121	30,062,664,657.34	1.0375	1.0375
交银理财稳享 灵动慧利日开 1号(180天持 有期)(畅享 版)理财产品	5811222012	2,877,216,859.02	1.0274	1.0274
交银理财稳享 灵动慧利日开 1号私银尊享 (180天持有 期)理财产品	5811222020	8,270,825,148.00	1.0296	1.0296

3.2 流动性风险分析。

日开产品严格按照监管要求保留 5%以上高流动性资产、保留 10%以上 7 日可变现资产。每日可通过现金头寸、正回购融资、卖出持仓债券、赎回相关资产等方式应对流动性。

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