

交银理财稳享灵动慧利日开 1 号（30 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（30 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000921000295）

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	1.83%	1.23%	3.05%
债权类资产	15.51%	80.32%	95.83%
权益类资产	0.00%	1.12%	1.12%
商品及金融衍生品类	0.00%	0.00%	0.00%
合计	17.34%	82.66%	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	186,626.27	3.05%
2	1003 他行存款	117,628.74	1.92%
3	1003 他行存款	105,109.74	1.72%
4	2020 年记账式付息(九期)国债	102,918.90	1.68%
5	1003 他行存款	83,939.85	1.37%
6	1003 他行存款	76,653.19	1.25%
7	1003 他行存款	67,297.60	1.10%
8	债券买入返售	67,234.73	1.10%
9	2022 年记账式贴现(六十五期)国债	61,852.79	1.01%
10	1003 他行存款	58,333.51	0.95%
合计		927,595.31	15.17%

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 2 号集合资产管理计划	4,000.00	资产买入	交银施罗德资产管理有限公司
2	交银国信·汇利 201 号集合资金信托计划	110,000.00	资产买入	交银国际信托有限公司
3	交银施罗德慧选添利 1 号集合资产管理计划	50,000.00	资产买入	交银施罗德基金管理有限公司
4	交银国信·汇利 201 号集合资金信托计划	433,681.50	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	371.83	交通银行股份有限公司
2	投资管理费	1,942.93	交银理财有限责任公司
3	销售手续费	386.73	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	1,501.83	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	2,321.01	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	2,637.61	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	5,670.95	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	661.22	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	4,882.43	交通银行股份有限公司
7	国家电网有限公司 2022 年度第十四 期超短期融资券	167.81	交通银行股份有限公司
8	淮安新城投资开发有限公司 2020 年 度第一期定向债务融资工具	3,954.98	交通银行股份有限公司
9	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	788.85	交通银行股份有限公司
10	20 淮安水利 PPN002	1,963.78	交通银行股份有限公司
11	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	305.68	交通银行股份有限公司
12	20 株洲城建 PPN002	205.61	交通银行股份有限公司
13	20 长春城投 PPN001	3,913.51	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 年度第四期定向债务融资工具	1,769.90	交通银行股份有限公司
15	20 青岛城投 PPN001	1,164.65	交通银行股份有限公司
16	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)	203.43	交通银行股份有限公司
17	青岛城市建设投资(集团)有限责任公 司 2021 年度第二期定向债务融资工 具	3,842.14	交通银行股份有限公司
18	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	760.92	交通银行股份有限公司
19	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	335.09	交通银行股份有限公司
20	孝感市城市建设投资公司 2022 年度	296.70	交通股份有限

	第一期定向债务融资工具		公司
21	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	1,524.47	交通银行股份有限公司
22	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	2,834.55	交通银行股份有限公司
23	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)	148.78	交通银行股份有限公司
24	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	297.54	交通银行股份有限公司
25	水发集团有限公司 2022 年度第一期短期融资券	1,173.64	交通银行股份有限公司
26	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	3,332.80	交通银行股份有限公司
27	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	1,319.18	交通银行股份有限公司
28	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	1,974.80	交通银行股份有限公司
29	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	736.68	交通银行股份有限公司
30	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	25.00	交通银行股份有限公司
31	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	865.62	交通银行股份有限公司
32	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	188.12	交通银行股份有限公司
33	衡阳市城市建设投资有限公司 2018 年度第三期中期票据	2,680.34	交通银行股份有限公司
34	19 重庆交投 MTN002	717.51	交通银行股份有限公司
35	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	304.07	交通银行股份有限公司
36	20 江苏资产 MTN001	2,086.21	交通银行股份有限公司
37	山西晋城无烟煤矿业集团有限责任公司	2,692.69	交通银行股份有限公司

	公司 2020 年度第十二期中期票据		公司
38	南通高新技术产业开发区总公司 2021 年度第一期中期票据	449.34	交通银行股份有限公司
39	21 淮安国投 MTN001	2,710.95	交通银行股份有限公司
40	中航国际租赁有限公司 2021 年度第 四期中期票据	774.82	交通银行股份有限公司
41	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	280.90	交通银行股份有限公司
42	景德镇市国资运营投资控股集团有 限责任公司 2021 年度第一期中期票 据	3,921.38	交通银行股份有限公司
43	西安曲江文化产业投资(集团)有限公 司 2021 年度第一期中期票据	412.79	交通银行股份有限公司
44	河钢集团有限公司 2021 年度第二期 中期票据	1,963.72	交通银行股份有限公司
45	青岛国信发展(集团)有限责任公司 2021 年度第三期中期票据	1,363.52	交通银行股份有限公司
46	苏州苏高新集团有限公司 2021 年度 第九期中期票据	411.63	交通银行股份有限公司
47	青岛国信发展(集团)有限责任公司 2021 年度第四期中期票据	818.00	交通银行股份有限公司
48	淄博市城市资产运营有限公司 2022 年度第一期中期票据	261.80	交通银行股份有限公司
49	山东恒邦冶炼股份有限公司 2022 年 度第二期中期票据	1,444.83	交通银行股份有限公司
50	广西北部湾投资集团有限公司 2022 年度第二期中期票据(品种一)	776.97	交通银行股份有限公司
51	衡阳市城市建设投资有限公司 2022 年度第四期中期票据	887.59	交通银行股份有限公司
52	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)	903.48	交通银行股份有限公司
53	工元宜居 2019 年第四期个人住房抵 押贷款资产支持证券优先 A-2 级资 产支持证券	7,093.16	交通银行股份有限公司
54	恒丰银行股份有限公司 2020 年无固 定期限资本债券	4,943.01	交通银行股份有限公司
55	20 越秀租赁 ABN001 优先 A3	200.87	交通银行股份有限

			公司、招商银行股份有限公司
56	华电金泰(北京)投资基金管理有限公司 2020 年度第二期招通金泰定向资产支持票据优先级	4,058.08	交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司
57	19 杭州银行二级	649.14	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	交银理财稳享灵动慧利日开 1 号（30 天持有期）理财产品			
报告期末产品份额总额	49,265,460,361.58			
报告期末产品资产净值（万元）	5,156,700.40			
期末杠杆水平	116.04%			
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
交银理财稳享灵动慧利日开 1 号（30 天持有期）理财产品	5811221093	45,330,492,814.04	1.0487	1.0487
交银理财稳享灵动慧利日开 1 号私银尊享（30 天持有期）理财产品	5811222027	2,719,897,765.99	1.0279	1.0279
交银理财稳享灵动慧利日开 1 号（30 天持有期）理财产品 C	5811222102	1,202,119,801.62	1.0143	1.0143

交银理财稳享 灵动慧利日开 1号（30天持 有期）理财产品D	5811222118	12,949,979.93	1.0089	1.0089
---	------------	---------------	--------	--------

3.2 流动性风险分析。

开放式产品严格按照监管要求保留 5%以上高流动性资产，开放前保留 10%以上 7 日可变现资产，可通过现金头寸、卖出持仓债券、赎回相关资产等方式应对流动性风险。

四、未来展望

一季度经济增速、3 月社融总量与结构等均超市场预期，但市场认为高频经济数据无起色、地产投资未反转、信贷高增持续性弱，甚至交易“通缩”和利空出尽的逻辑，债市收益率下行。当前债券市场对二季度经济同比增速高、环比增速低有较强预期，对经济基本面弱的一面预期反应较为充分。叠加短期流动性充裕，市场短期内对利空消息相对不敏感，长端胜率尚可，赔率不高，但长期看，随着居民收入改善，投资项数据上行，长端利率仍可能面临一定压力。信用方面，当前信用利差回到历史低位，短久期、公募债券的信用利差继续压缩的空间较为有限。鉴于配置力量仍在，中等久期、私募债券的信用利差仍有一定压缩机会，品种下沉优于等级下沉。策略上将继续保持中性杠杆和中短久期。

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