

交银理财稳享灵动慧利日开 10 号（180 天持有期）  
理财产品定期报告（2024 年年度）

尊敬的客户：

我司交银理财稳享灵动慧利日开 10 号（180 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000924000920）2024 年年度定期报告公告如下：

报告期为 2024 年 7 月 23 日至 2024 年 12 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	5.63%	1.46%	7.09%
债权类资产	4.82%	88.09%	92.91%
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	10.45%	89.55%	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	1,166.06	5.63%
2	债券买入返售	1,000.06	4.82%
3	24 特别国债 04	828.17	4.00%
4	2024 年记账式付息(六期)国债	521.39	2.52%
5	国家开发银行 2024 年第十五期金融债券	519.96	2.51%
6	24 西高科	339.14	1.64%
7	活期存款	303.22	1.46%
8	2024 年记账式付息(四期)国债	261.97	1.26%
9	24 付息国债 18	252.13	1.22%
10	远东国际融资租赁有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)	191.04	0.92%
合计		5,383.15	25.97%

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。  
报告期内，本产品未投资于关联方发行的资产管理产品。

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	0.38	交通银行股份有限公司
2	投资管理费	2.88	交银理财有限责任公司

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	2021 年第一期成都空港兴城投资集团有限公司公司债券	26.79	国信证券股份有限公司
2	2021 年第一期海宁市尖山新区开发有限公司公司债券	49.42	国信证券股份有限公司
3	2022 年第一期湖州莫干山高新集团有限公司县城新型城镇化建设专项企业债券	7.98	国信证券股份有限公司
4	蚌埠市城市投资控股有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具	5.04	兴业银行股份有限公司
5	常德市城市建设投资集团有限公司 2023 年度第七期定向债务融资工具	5.00	交通银行股份有限公司
6	常德市城市建设投资集团有限公司 2024 年度第三期中期票据(品	23.77	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限

	种一)		公司
7	常熟市滨江城市建设经营投资有限责任公司 2024 年度第二期定向债务融资工具	1.63	兴业银行股份有限公司
8	成都经开产业投资集团有限公司 2020 年度第一期定向债务融资工具	1.61	国信证券股份有限公司
9	成都经开产业投资集团有限公司 2021 年度第三期中期票据	1.59	国信证券股份有限公司
10	成都经开产业投资集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	3.29	国信证券股份有限公司
11	成都经开国投集团有限公司 2021 年度第三期中期票据	0.97	兴业银行股份有限公司
12	成都九联投资集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	1.00	中信银行股份有限公司
13	成都香城城市发展有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	47.26	交通银行股份有限公司
14	成都香城投资集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	1.64	兴业银行股份有限公司
15	成都兴城投资集团有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行科技创新可续期公司债券(第三期)(品种二)	0.97	国信证券股份有限公司
16	成都兴城投资集团有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行科技创新可续期公司债券(第一期)(品种二)	2.02	国信证券股份有限公司
17	城发投资集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	6.92	兴业银行股份有限公司
18	滁州市同创建设投资有限责任公司 2024 年度第三期定向债务融资工具	35.39	交通银行股份有限公司
19	滁州市同创建设投资有限责任公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	3.31	交通银行股份有限公司
20	抚州市市属国有资产投资控股集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第三期)	4.78	国信证券股份有限公司

21	抚州市市属国有资产投资控股集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第五期)	45.27	国信证券股份有限公司
22	甘肃金融控股集团有限公司 2024 年度第二期中期票据	4.76	兴业银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
23	赣州城市开发投资集团有限责任公司 2020 年度第一期定向债务融资工具	4.89	国信证券股份有限公司
24	赣州城市开发投资集团有限责任公司 2022 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)	8.07	国信证券股份有限公司
25	海尔集团(青岛)金盈控股有限公司 2024 年度第三期中期票据	4.77	兴业银行股份有限公司
26	海尔集团(青岛)金盈控股有限公司 2024 年度第一期超短期融资券	23.03	兴业银行股份有限公司
27	海尔消费金融有限公司 2024 年金融债券(第一期)	8.73	兴业银行股份有限公司
28	邯郸城市发展投资集团有限公司 2024 年度第三期超短期融资券	0.97	中信银行股份有限公司
29	河南航空港投资集团有限公司 2024 年度第十期中期票据	1.95	兴业银行股份有限公司
30	河南航空港投资集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	1.01	交通银行股份有限公司
31	河南交通投资集团有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行可续期公司债券(第五期)(品种二)	3.18	国信证券股份有限公司
32	河南省郑州新区建设投资有限公司 2024 年度第二期定向债务融资工具	47.24	中信银行股份有限公司
33	黑牡丹(集团)股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	21.87	国信证券股份有限公司
34	湖北联投资本投资发展有限公司 2024 年度第三期定向债务融资工具(品种一)	6.07	交通银行股份有限公司
35	湖南建工集团有限公司 2024 年度	2.90	中信银行股份有限公司

	第二期超短期融资券(科创票据)		司，兴业银行股份有限公司
36	湖南建工集团有限公司 2024 年度 第一期中期票据(科创票据)	9.74	中信银行股份有限公司， 兴业银行股份有限公司
37	湖州莫干山高新集团有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工 具	1.63	交通银行股份有限公司
38	湖州市南浔区交通投资集团有限 公司 2024 年度第五期定向债务融 资工具	23.68	国信证券股份有限公司
39	华能贵诚信托有限公司 2024 年度 第三期启明定向资产支持票据优 先 B 级	0.29	中信银行股份有限公司
40	淮安开发控股有限公司 2022 年公 开发行公司债券(面向专业投资 者)(第三期)	3.20	国信证券股份有限公司
41	淮安开发控股有限公司 2024 年度 第七期定向债务融资工具	1.93	中信银行股份有限公司
42	淮安市国有联合投资发展集团有 限公司 2022 年面向专业投资者非 公开发行公司债券(第二期)	7.99	国信证券股份有限公司
43	淮安市国有联合投资发展集团有 限公司 2022 年面向专业投资者非 公开发行公司债券(第三期)	29.45	国信证券股份有限公司
44	淮安市投资控股集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工 具	11.30	兴业银行股份有限公司
45	淮安新城投资开发有限公司 2022 年度第二期定向债务融资工具	1.63	兴业银行股份有限公司
46	淮北市建投控股集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	25.49	兴业银行股份有限公司
47	嘉兴市高等级公路投资有限公司 2022 年面向专业投资者非公开发 行公司债券(第三期)(品种二)	0.99	国信证券股份有限公司
48	江东控股集团有限责任公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	2.39	中信银行股份有限公司
49	江苏华靖资产经营有限公司 2024	1.94	中信银行股份有限公司

	年度第五期定向债务融资工具		
50	江苏开晟产业发展集团有限公司 2024 年度第四期中期票据	2.92	兴业银行股份有限公司
51	江苏银行股份有限公司 2024 年无 固定期限资本债券(第二期)	3.92	中信银行股份有限公司
52	江苏悦达集团有限公司 2024 年度 第七期中期票据	46.96	中信银行股份有限公 司，交通银行股份有限 公司
53	江苏悦达集团有限公司 2024 年度 第三期定向债务融资工具	7.80	兴业银行股份有限公司
54	江苏悦达集团有限公司 2024 年度 第四期定向债务融资工具	47.44	中信银行股份有限公司
55	江西省金融控股集团有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行 公司债券(第四期)	4.91	国信证券股份有限公司
56	晋城市国有资本投资运营有限公 司 2024 年度第三期中期票据	0.97	兴业银行股份有限公司
57	靖江市滨江新城投资开发有限公 司 2024 年度第二期中期票据	23.90	兴业银行股份有限公司
58	九州通医药集团股份有限公司 2024 年度第二期资产支持票据优 先 A 级	45.63	中信银行股份有限公 司，交通银行股份有限 公司，兴业银行股份有 限公司
59	九州通医药集团股份有限公司 2024 年度第一期资产支持票据优 先 A 级	23.32	中信银行股份有限公 司，交通银行股份有限 公司，兴业银行股份有 限公司
60	克拉玛依市城市建设投资发展有 限责任公司 2023 年面向专业投资 者公开发行公司债券(第一期)	1.64	国信证券股份有限公司
61	溧阳市城市建设发展集团有限公 司 2024 年度第三期中期票据	0.97	兴业银行股份有限公司
62	连云港市城建控股集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工 具	1.64	中信银行股份有限公司
63	洛阳城市发展投资集团有限公司 2023 年度第四期定向债务融资工 具	1.61	华夏银行股份有限公司

64	洛阳城市发展投资集团有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工 具	4.88	中信银行股份有限公司
65	洛阳城乡建设投资集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工 具	3.25	交通银行股份有限公司
66	洛阳城乡建设投资集团有限公司 2023 年度第七期定向债务融资工 具	1.61	华夏银行股份有限公司
67	洛阳国宏投资控股集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工 具	7.68	交通银行股份有限公 司，兴业银行股份有限 公司
68	南阳投资集团有限公司 2024 年度 第一期定向债务融资工具	23.71	中信银行股份有限公 司，华夏银行股份有限 公司
69	平安国际融资租赁有限公司 2024 年度第二期中期票据	24.13	中信银行股份有限公 司，交通银行股份有限 公司
70	平安国际融资租赁有限公司 2024 年度第五期中期票据	1.61	兴业银行股份有限公司
71	平安银行股份有限公司 2024 年无 固定期限资本债券	5.16	交通银行股份有限公 司，兴业银行股份有限 公司
72	平阳县城市建设投资有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工 具	9.53	中信银行股份有限公司
73	青岛城投创业投资有限公司 2024 年度第二期中期票据(科创票据)	23.79	中信银行股份有限公司
74	青岛国信发展(集团)有限责任公司 2023 年面向专业投资者公开发 行公司债券(第四期)(品种二)	1.63	国信证券股份有限公司
75	青岛国信发展(集团)有限责任公司 2023 年面向专业投资者公开发 行公司债券(第五期)(品种一)	1.58	国信证券股份有限公司
76	青岛国信发展(集团)有限责任公司 2024 年面向专业投资者公开发 行公司债券(第一期)(品种二)	4.92	国信证券股份有限公司
77	青岛胶州湾发展集团有限公司	0.99	中信银行股份有限公司

	2024 年度第一期定向债务融资工具(品种二)		
78	青岛胶州湾发展集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具(品种一)	0.99	中信银行股份有限公司
79	青岛经济技术开发区投资控股集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行科技创新公司债券(第一期)	22.64	国信证券股份有限公司
80	青岛经济技术开发区投资控股集团有限公司 2024 年非公开发行科技创新公司债券(第一期)(品种二)	22.74	国信证券股份有限公司
81	青岛军民融合发展集团有限公司 2024 年度第五期中期票据	0.98	国信证券股份有限公司
82	青岛市即墨区城市开发投资有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	1.63	交通银行股份有限公司
83	青岛市即墨区城市旅游开发投资有限公司 2022 年度第二期定向债务融资工具	3.19	兴业银行股份有限公司
84	青岛西海岸新区海洋控股集团有限公司 2024 年度第六期定向债务融资工具(科创票据)	23.76	兴业银行股份有限公司，国信证券股份有限公司
85	如东县东泰社会发展投资有限责任公司 2024 年度第二期中期票据	47.43	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
86	如皋市经济贸易开发有限公司 2022 年度第四期定向债务融资工具	3.21	兴业银行股份有限公司
87	厦门海沧投资集团有限公司 2024 年度第四期中期票据	23.73	交通银行股份有限公司
88	厦门象屿集团有限公司 2022 年度第一期中期票据(科创票据)	0.99	兴业银行股份有限公司
89	厦门象屿金象控股集团有限公司 2024 年度第二期短期融资券	2.90	交通银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
90	山东高速集团有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行科技创新	1.96	国信证券股份有限公司



	公司债券(第四期)		
91	山东宏桥新型材料有限公司 2023 年度第二期绿色中期票据	0.99	中信银行股份有限公司
92	山东宏桥新型材料有限公司 2024 年度第一期中期票据	1.65	中信银行股份有限公司
93	山东汇通金融租赁有限公司 2024 年第一期金融债券	4.94	交通银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司，华夏银行股份有限公司
94	山东能源集团有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行企业债券 (第一期)(品种一)	2.90	国信证券股份有限公司
95	陕西电子信息集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	46.82	中信银行股份有限公司，交通银行股份有限公司
96	上饶市国有资产经营集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具(品种二)	1.64	中信银行股份有限公司
97	上饶市国有资产经营集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具(品种一)	22.99	中信银行股份有限公司
98	上饶投资控股集团有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具	25.34	兴业银行股份有限公司
99	绍兴滨海新区发展集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)	24.43	国信证券股份有限公司
100	绍兴袍江经济技术开发区投资发展集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	1.65	中信银行股份有限公司
101	绍兴市财政投资有限公司 2020 年非公开发行公司债券(第一期)	4.94	国信证券股份有限公司
102	深圳市百业源投资有限公司 2024 年度第一期中期票据	4.83	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
103	深圳资产管理有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第二期)(品种一)	1.98	国信证券股份有限公司
104	声赫(深圳)商业保理有限公司	7.16	兴业银行股份有限公司

	2024 年度第一期锦城定向资产支持票据优先级		
105	嵊州市城市建设投资发展集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)	47.83	国信证券股份有限公司
106	嵊州市交通投资发展集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)	22.75	国信证券股份有限公司
107	嵊州市交通投资发展集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)	46.14	国信证券股份有限公司
108	嵊州市投资控股有限公司 2022 年度第二期定向债务融资工具	3.20	兴业银行股份有限公司
109	嵊州市投资控股有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	1.66	兴业银行股份有限公司
110	嵊州市投资控股有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第三期)	1.93	国信证券股份有限公司
111	十堰市城市发展控股集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	1.60	交通银行股份有限公司
112	蜀道投资集团有限责任公司 2024 年面向专业投资者公开发行可续期公司债券(第三期)	4.81	国信证券股份有限公司
113	苏州漕湖产业发展集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	1.65	华夏银行股份有限公司
114	宿州市城市建设投资集团(控股)有限公司 2024 年度第二期短期融资券	23.51	兴业银行股份有限公司
115	台州市路桥区国有资产运营有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)	21.27	国信证券股份有限公司
116	太原市龙城发展投资集团有限公司 2024 年度第三期定向债务融资工具(品种一)	3.16	兴业银行股份有限公司
117	泰安市泰山财金投资集团有限公司 2024 年度第一期中期票据(品	1.01	华夏银行股份有限公司

	种一)		
118	泰兴市城市投资发展集团有限公司 2022 年度第四期定向债务融资工具	2.40	华夏银行股份有限公司
119	泰兴市城市投资发展集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	1.65	兴业银行股份有限公司
120	泰兴市城市投资发展集团有限公司 2023 年度第八期定向债务融资工具	3.27	兴业银行股份有限公司
121	泰兴市城市投资发展集团有限公司 2023 年度第七期定向债务融资工具	1.65	兴业银行股份有限公司
122	泰兴市城市投资发展集团有限公司 2023 年度第四期定向债务融资工具	1.63	兴业银行股份有限公司
123	泰兴市城市投资发展集团有限公司 2024 年度第三期中期票据	47.56	交通银行股份有限公司
124	泰州市金东城市建设投资集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	1.02	兴业银行股份有限公司
125	特变电工股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行科技创新 可续期公司债券(高成长产业 债)(第一期)	3.90	国信证券股份有限公司
126	同安控股有限责任公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第一期)	48.35	国信证券股份有限公司
127	同安控股有限责任公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第一期)	3.31	国信证券股份有限公司
128	伟驰控股集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债 券(第一期)(品种一)	23.13	国信证券股份有限公司
129	乌鲁木齐高新投资发展集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公 开发行公司债券(第一期)	3.22	国信证券股份有限公司
130	乌鲁木齐高新投资发展集团有限 公司 2024 年度第四期中期票据	0.98	交通银行股份有限公 司，兴业银行股份有限

			公司，华夏银行股份有限公司
131	无锡财通融资租赁有限公司 2024 年度第二期定向债务融资工具	1.95	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
132	西安沣东控股有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具	70.90	国信证券股份有限公司
133	西安高新控股有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	1.60	中信银行股份有限公司
134	西安高新控股有限公司 2023 年面向专业机构投资者非公开发行公司债券(第一期)	10.12	国信证券股份有限公司
135	新疆金融投资(集团)有限责任公司 2023 年度第一期定向债务融资工具(品种二)	1.01	交通银行股份有限公司
136	新疆金融投资(集团)有限责任公司 2024 年度第二期定向债务融资工具	50.91	中信银行股份有限公司
137	新疆金融投资(集团)有限责任公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	4.88	中信银行股份有限公司
138	新疆可克达拉市国有资本投资运营有限责任公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	5.83	交通银行股份有限公司
139	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	1.58	交通银行股份有限公司
140	徐州市新盛投资控股集团有限公司 2024 年度第六期中期票据	0.97	交通银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司，华夏银行股份有限公司
141	盐城高新区投资集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	1.62	中信银行股份有限公司
142	盐城高新区投资集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	1.65	中信银行股份有限公司
143	盐城市国有资产投资集团有限公司	46.64	华夏银行股份有限公司

	司 2022 年度第二期定向债务融资工具		
144	盐城市海兴集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	3.19	中信银行股份有限公司
145	扬州广合国有资本运营集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第三期)(品种一)	1.58	国信证券股份有限公司
146	永康市国有资本投资控股集团有限公司 2021 年非公开发行公司债券(第一期)	1.98	国信证券股份有限公司
147	远东国际融资租赁有限公司 2024 年度第十期超短期融资券	3.15	兴业银行股份有限公司
148	远东国际融资租赁有限公司 2024 年度第一期中期票据	3.26	交通银行股份有限公司，国信证券股份有限公司
149	远东国际融资租赁有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)	0.96	国信证券股份有限公司
150	远东租赁 2024 年度第一期助力产业升级定向资产支持票据优先 A2 级	159.78	兴业银行股份有限公司，国信证券股份有限公司
151	长沙银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券	1.95	兴业银行股份有限公司
152	长兴交通投资集团有限公司 2022 年非公开发行公司债券(第一期)	3.33	国信证券股份有限公司
153	浙江金汇五金产业集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)	21.39	国信证券股份有限公司
154	浙江金汇五金产业集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)(品种一)	1.99	国信证券股份有限公司
155	浙江省新昌县投资发展集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)	1.59	国信证券股份有限公司
156	浙江长兴经济发展集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	46.47	华夏银行股份有限公司
157	浙商中拓集团股份有限公司 2024	23.52	兴业银行股份有限公司

	年度第十四期超短期融资券		
158	浙越资产管理有限公司 2024 年度 第一期超短期融资券	47.48	中信银行股份有限公司
159	中国东方航空集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	23.71	中信银行股份有限公司
160	中国康富国际租赁股份有限公司 2024 年度第四期绿色中期票据(碳 中和债)	4.86	交通银行股份有限公司
161	中铁四局集团有限公司 2024 年度 第二期保供稳链资产支持票据(科 创票据)优先级	11.13	交通银行股份有限公 司，兴业银行股份有限 公司
162	中铁一局集团有限公司 2024 年度 第一期资产支持票据(科创票据)优 先级	46.55	交通银行股份有限公司
163	重庆医药(集团)股份有限公司 2024 年度第三期中期票据	2.98	中信银行股份有限公司
164	重庆渝隆资产经营(集团)有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发 行公司债券(第二期)	28.97	国信证券股份有限公司
165	重庆渝隆资产经营(集团)有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发 行公司债券(第一期)	4.85	国信证券股份有限公司
166	重庆渝隆资产经营(集团)有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发 行公司债券(第一期)	1.00	国信证券股份有限公司
167	舟山海城建设投资集团有限公司 2022 年面向专业投资者非公开发 行公司债券(第二期)	0.59	国信证券股份有限公司
168	舟山海城建设投资集团有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行 公司债券(第一期)	2.03	国信证券股份有限公司
169	舟山海城建设投资集团有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行 公司债券(第一期)(品种一)	23.45	国信证券股份有限公司
170	舟山交通投资集团有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司 债券(第二期)	23.32	国信证券股份有限公司
171	淄博市城市资产运营有限公司	23.23	国信证券股份有限公司

	2021 年非公开发行公司债券(第一期)(品种二)		
--	---------------------------	--	--

### 三、投资运作分析

#### 3.1 基本情况。

期末产品份额总额为 187,467,486.93 份，产品单位净值为 1.0325，产品单位累计净值为 1.0325，产品资产净值为 193,572,466.74 元，期末杠杆水平为 107%。今年以来年化收益率<sup>1</sup>为 7.3225%。

#### 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。

### 四、未来展望

2024 年四季度债券市场各品种行情得到修复，利率顺畅下行。10 月债市高波动特征仍旧较为明显，节后资金面明显转松，中旬多部委相继召开新闻发布会不及预期，债市赎回潮情绪逐步趋于冷静，股市较节前高点大幅回调，10 年期国债收益率震荡下行，曲线形态略趋平坦。10 月下旬，股债跷跷板效应有所增强，叠加财政政策相关传闻持续扰动，债市情绪仍偏谨慎，10 年期国债收益率有所上行。11 月，全国人大常委会明确化债方案后多地公告置换隐性债务专项债发行计划，债市供给担忧有所升温，但央行公开市场投放呵护资金面平稳偏松，地方债发行结果较好减轻市场供给担忧，受此影响债市再度走

<sup>1</sup> 今年以来年化收益率(%)=(统计日的【累计单位净值】-基准日的【累计单位净值】)/基准日的【单位净值】/(统计日-基准日)\*365\*100%

统计日：取 2024 年 12 月 31 日（含）之前最新可得的【累计单位净值】所对应的日期。

基准日：取 2023 年年末最后一自然日与【产品成立单位净值日期】中更晚的那个时点（若该日期无【累计单位净值】，则取该日期之前最新可得【累计单位净值】所对应的日期。）

结果保留 4 位小数（四舍五入）。

强，10 年国债收益率创 2002 年 5 月以来新低，全月国债收益率曲线平行下移。12 月，随着地方债供给冲击结束，叠加政治局会议在 2011 年来首次重提“适度宽松的货币政策”，债市热情被进一步引燃，在年末抢跑行情主推下，债市收益率持续下破历史低位，10 年国债利率下破 1.7%。

展望 2025 年一季度，由于经济处于弱复苏阶段，但是市场对货币政策抱有较强预期，所以债市收益率难以大幅回调。在节奏上需要关注央行降准降息预期的反复以及政策落地后市场是否利多出尽或者政策不及预期引发的调整。一季度新增专项债规模可控，同时当前财政的首要任务仍然是化债，因而需要低利率环境的支持，财政政策对债市的风险扰动整体可控。此外一季度的不确定因素来自特朗普就任后的关税政策以及国内政策应对。整体而言，一季度债券市场机会大于风险，但由于利率处于低位，故市场延续宽幅震荡、波动加大的特征。

## 五、托管人报告

### 5.1 报告期内本产品托管人遵规守信情况声明。

本报告期内，本产品托管人在对本产品的托管过程中，严格遵守法律法规和托管协议的有关规定，不存在损害理财产品份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了产品托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本理财产品投资运作、净值计算、利润分配等情况的说明。

本报告期内，托管人未发现本产品的管理人——交银理财有限责任公司在本产品的投资运作、产品资产净值计算、产品份额申购赎回价格计算、产品费用开支等过程中存在损害产品份额持有人利益的行为。本报告期内，本产品未进行利润分配。



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  
2025 年 3 月 24 日