

交银理财稳享固收精选日开 20 号（365 天持有期）  
理财产品定期报告（2026 年第一季度）

尊敬的客户：

我司交银理财稳享固收精选日开 20 号（365 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000924000716）2026 年第一季度定期报告公告如下：

报告期为 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	穿透前金额 （元）	占全部产品总资产的比例（%）	穿透后金额 （元）	占全部产品总资产的比例（%）
现金及银行存款	484,356,732.13	9.34	1,096,081,080.05	20.26
同业存单	0.00	0.00	126,966,171.45	2.35
拆放同业及债券买入返售	0.00	0.00	422,696,590.24	7.81
债券	162,017,319.13	3.12	3,082,337,224.81	56.99
非标准化债权类资产	0.00	0.00	0.00	0.00
权益类投资	0.00	0.00	194,406,584.57	3.59
金融衍生品	0.00	0.00	0.00	0.00
代客境外理财投资 QDII	0.00	0.00	0.00	0.00
商品类资产	0.00	0.00	0.00	0.00
另类资产	0.00	0.00	0.00	0.00
公募基金	0.00	0.00	486,432,168.31	8.99
私募基金	0.00	0.00	0.00	0.00

资产管理产品	4,540,738,804.64	87.54	0.00	0.00
委外投资——协议方式	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	5,187,112,855.90	100.00	5,408,919,819.43	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	28,245.02	5.22%
2	活期存款	20,190.28	3.73%
3	2025 年记账式付息(八期)国债	16,201.73	3.00%
4	债券买入返售	11,881.84	2.20%
5	1003 他行存款	10,898.59	2.01%
6	1003 他行存款	8,171.71	1.51%
7	活期存款	5,591.05	1.03%
8	1003 他行存款	5,557.94	1.03%
9	1003 他行存款	5,449.30	1.01%
10	1003 他行存款	5,446.48	1.01%
合计		117,633.94	21.75%

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·汇盈 27 号集合资金信托计划	32,700.00	资产买入	交银国际信托有限公司
2	交银国信·汇盈 35 号集合资金信托计划	10,100.00	资产买入	交银国际信托有限公司

3	交银国信·汇盈 27 号集合资金信托计划	37,749.28	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司
4	交银国信·汇盈 35 号集合资金信托计划	10,611.12	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司
5	交银施罗德资管卓远 1 号集合资产管理计划	3,529.19	资产卖出或到期	交银施罗德资产管理有限公司

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	投资管理费	198.62	交银理财有限责任公司
2	托管费	28.56	交通银行股份有限公司
3	销售服务费	265.89	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	2021 年第一期成都空港兴城投资集团有限公司公司债券	400.52	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	1,331.00	国信证券股份有限公司
3	2021 年第一期汉口银行股份有限公司无固定期限资本债券	246.22	交通银行股份有限公司
4	2022 年重庆市政府专项债券(四期)	5.53	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
5	2024 年上海市政府再融资专项债券(四期)	248.90	交通银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
6	2025 年招商银行股份有限公司无固定期限资本债券(第一期)(债券	489.48	兴业银行股份有限公司

	通)		
7	2026 年广汽汇理汽车金融有限公司绿色金融债券(第一期)(债券通)	119.84	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
8	安徽皖投置业有限责任公司 2024 年度第一期定向债务融资工具(项目收益)	182.84	中信银行股份有限公司
9	安信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第四期)(品种二)	486.58	国信证券股份有限公司
10	北京城建集团有限责任公司 2025 年度第五期中期票据(品种一)	953.85	国信证券股份有限公司
11	北京城建集团有限责任公司 2026 年度第一期中期票据	119.54	中信银行股份有限公司
12	北京电子城高科技集团股份有限公司 2025 年度第一期中期票据(品种一)	727.47	中信银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
13	北京银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券	121.88	兴业银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
14	本钢集团有限公司 2025 年度第一期科技创新债券	121.00	交通银行股份有限公司
15	沧州交通发展(集团)有限责任公司 2023 年度第三期定向债务融资工具(专项乡村振兴)	239.69	中信银行股份有限公司
16	曹妃甸国控投资集团有限公司 2024 年度第二期中期票据	492.16	中信银行股份有限公司
17	常德市城市建设投资集团有限公司 2023 年度第六期定向债务融资工具	398.40	交通银行股份有限公司
18	成都经开产业投资集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	371.53	国信证券股份有限公司
19	成都香城投资集团有限公司 2021 年度第一期中期票据	244.31	中信银行股份有限公司
20	城发投资集团有限公司 2025 年度第一期中期票据(品种一)	89.12	中信银行股份有限公司
21	滁州经济技术开发区总公司 2023 年度第一期中期票据	368.82	交通银行股份有限公司, 兴业股份有限

			公司
22	大理经济开发投资集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发 行公司债券	118.75	红塔证券股份有限公司
23	福建华电福瑞能源发展有限公司 2024 年度第三期中期票据	12.33	兴业银行股份有限公司
24	福建华电福瑞能源发展有限公司 2025 年度第二期中期票据	12.35	兴业银行股份有限公司
25	福建省能源集团有限责任公司 2025 年度第三期中期票据	4.45	中信银行股份有限公司
26	福建省投资开发集团有限责任公 司 2024 年度第九期中期票据	7.76	兴业银行股份有限公司
27	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)	263.10	国信证券股份有限公司
28	赣州城市开发投资集团有限责任 公司 2021 年度第三期中期票据	489.62	国信证券股份有限公司
29	广州地铁集团有限公司 2025 年 度第十期中期票据	121.08	交通银行股份有限公司
30	广州越秀产业投资有限公司 2024 年度第一期中期票据(科创票据)	13.70	兴业银行股份有限公司
31	国家电力投资集团有限公司 2024 年度第八期中期票据(品种二)	11.34	中信银行股份有限公司
32	国家电力投资集团有限公司 2024 年度第八期中期票据(品种一)	21.33	中信银行股份有限公司
33	国家电力投资集团有限公司 2024 年度第二十八期中期票据	10.03	中信银行股份有限公司
34	国家电力投资集团有限公司 2024 年度第三十二期中期票据(品种 二)	19.95	中信银行股份有限公司
35	国家电力投资集团有限公司 2024 年度第三十二期中期票据(品种 一)	17.67	中信银行股份有限公司
36	国家电力投资集团有限公司 2024 年度第三十四期中期票据	44.28	华夏银行股份有限公司
37	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第二十二期中期票据(能源保	31.21	中信银行股份有限公 司，兴业银行股份有限

	供特别债)		公司
38	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第二十四期中期票据(能源保供特别债)	11.13	中信银行股份有限公司
39	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第二十五期中期票据	36.75	中信银行股份有限公司
40	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第二十一期中期票据(能源保供特别债)	31.28	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
41	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第十八期中期票据(能源保供特别债)	15.57	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
42	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第十九期中期票据(能源保供特别债)	23.46	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
43	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第十七期中期票据	15.57	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
44	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第十四期中期票据(能源保供特别债)	9.01	中信银行股份有限公司
45	国家电力投资集团有限公司 2025 年度第四期中期票据(能源保供特别债)	12.19	中信银行股份有限公司
46	国家电力投资集团有限公司 2025 年面向专业投资者公开发行科技创新可续期公司债券(第十期)	6.70	国信证券股份有限公司
47	国家电网有限公司 2024 年度第一期中期票据	4.46	中信银行股份有限公司
48	国家能源投资集团有限责任公司 2024 年度第一期中期票据	4.46	中信银行股份有限公司
49	国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券(第一期)	374.35	国信证券股份有限公司
50	海安开发区建设投资有限公司 2025 年度第三期超短期融资券	192.58	兴业银行股份有限公司
51	海尔融资租赁股份有限公司 2025 年度第二期定向债务融资工具	193.50	中信银行股份有限公司
52	海发宝诚融资租赁有限公司 2024	97.09	交通银行股份有限公司

	年度第四期中期票据		
53	海通恒信国际融资租赁股份有限公司 2025 年度第三期短期融资券	479.23	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
54	杭州临平开发投资集团有限公司 2023 年度第三期定向债务融资工具	49.08	中信银行股份有限公司
55	合肥恒创智能科技有限公司 2025 年度第一期中期票据	238.41	中信银行股份有限公司
56	合肥市建设投资控股(集团)有限公司 2025 年度第二期超短期融资券	120.56	交通银行股份有限公司
57	合肥维信诺科技有限公司 2026 年度第二期科技创新债券	118.98	兴业银行股份有限公司
58	河钢集团有限公司 2025 年度第二十三期中期票据	120.73	交通银行股份有限公司
59	河钢集团有限公司 2025 年度第十六期中期票据	121.93	交通银行股份有限公司
60	河钢集团有限公司 2026 年度第五期中期票据	119.68	交通银行股份有限公司
61	河南交通投资集团有限公司 2024 年度第八期中期票据	6.70	兴业银行股份有限公司
62	河南交通投资集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	3.33	兴业银行股份有限公司
63	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永续期公司债券(第五期)(品种二)	11.33	国信证券股份有限公司
64	黑牡丹(集团)股份有限公司 2024 年度第二期中期票据	178.96	兴业银行股份有限公司
65	衡阳市城市建设投资有限公司 2021 年度第三期定向债务融资工具	342.77	交通银行股份有限公司
66	湖南金阳投资集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	116.37	兴业银行股份有限公司
67	湖南银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券	245.27	兴业银行股份有限公司
68	湖州经开投资发展集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	269.01	兴业银行股份有限公司

69	湖州莫干山高新集团有限公司 2023 年度第三期中期票据	245.55	兴业银行股份有限公司
70	湖州市城市投资发展集团有限公司 2026 年度第二期中期票据	119.68	交通银行股份有限公司
71	华电国际电力股份有限公司 2023 年度第九期中期票据	25.81	兴业银行股份有限公司
72	华电国际电力股份有限公司 2024 年度第二期中期票据	7.84	兴业银行股份有限公司
73	华电国际电力股份有限公司 2025 年度第八期中期票据	5.57	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
74	华电国际电力股份有限公司 2025 年度第九期中期票据	7.79	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
75	华电国际电力股份有限公司 2025 年度第七期中期票据(能源保供特 别债)	11.16	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
76	华电国际电力股份有限公司 2025 年度第十期中期票据	17.81	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
77	华电国际电力股份有限公司 2025 年度第四期中期票据	3.37	兴业银行股份有限公司
78	华电国际电力股份有限公司 2025 年度第一期中期票据	5.52	中信银行股份有限公司
79	华能天成融资租赁有限公司 2025 年度第四期绿色中期票据(碳中和 债)	120.46	交通银行股份有限公司
80	华润股份有限公司 2023 年度第 四期中期票据	64.97	兴业银行股份有限公司
81	华润股份有限公司 2026 年度第 一期中期票据	122.91	中信银行股份有限公司
82	徽商银行股份有限公司 2024 年 无固定期限资本债券	613.11	兴业银行股份有限公司
83	吉林电力股份有限公司 2023 年 度第一期中期票据(可持续挂钩/ 乡村振兴)	258.26	兴业银行股份有限公司
84	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	124.53	国信证券股份有限公司



	行公司债券(第三期)(品种二)		
85	江苏高淳经济开发区开发集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	122.96	兴业银行股份有限公司
86	江苏银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券(第二期)	489.59	中信银行股份有限公司
87	江苏银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)(债券通)	244.14	中信银行股份有限公司
88	江西赣粤高速公路股份有限公司 2024 年度第一期中期票据	3.37	兴业银行股份有限公司
89	江西省国有资本运营控股集团有限公司 2025 年度第二期科技创新债券	120.66	交通银行股份有限公司
90	江西省建工集团有限责任公司 2025 年度第一期中期票据	122.40	中信银行股份有限公司
91	江西省水利投资集团有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	23.14	国信证券股份有限公司
92	江西文化演艺发展集团有限责任公司 2025 年度第一期超短期融资券	344.69	中信银行股份有限公司
93	江西文化演艺发展集团有限责任公司 2026 年度第一期超短期融资券	113.41	中信银行股份有限公司
94	金华金开国有资本控股集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	458.54	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
95	九江银行股份有限公司 2021 年无固定期限资本债券(第二期)	740.85	兴业银行股份有限公司
96	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)	98.18	国信证券股份有限公司
97	乐清市城市建设投资集团有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具	197.28	中信银行股份有限公司
98	临沂投资发展集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具(可	461.32	华夏银行股份有限公司

	持续挂钩)		
99	龙岩文旅汇金发展集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)	132.69	国信证券股份有限公司
100	龙源电力集团股份有限公司 2024 年度第二期中期票据	5.58	中信银行股份有限公司
101	眉山环天实业有限公司 2025 年度第一期定向债务融资工具	229.32	国信证券股份有限公司
102	南京高淳国有资产经营控股集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	122.20	兴业银行股份有限公司
103	内江投资控股集团有限公司 2021 年度第一期定向债务融资工具	349.17	国信证券股份有限公司
104	宁波市镇海区海江投资发展有限公司 2026 年度第一期中期票据	119.90	交通银行股份有限公司
105	宁波银行股份有限公司 2025 年第一期无固定期限资本债券	121.83	兴业银行股份有限公司
106	平安国际融资租赁有限公司 2024 年度第五期中期票据	587.15	兴业银行股份有限公司
107	平安银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券	122.46	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
108	平安银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第二期)(债券通)	181.91	兴业银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
109	浦鑫安居 2021 年第二期个人住房抵押贷款优先 A-2 级资产支持证券	5.28	交通银行股份有限公司
110	青岛城市建设投资(集团)有限责任公司 2025 年度第九期中期票据(品种一)	120.88	交通银行股份有限公司
111	青岛城市建设投资(集团)有限责任公司 2026 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第四期)(品种二)	882.19	国信证券股份有限公司
112	青岛西海岸新区海洋控股集团有限公司 2026 年度第一期短期融资券	4.61	中信银行股份有限公司

113	曲靖市麒麟区城乡建设投资(集团)有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券	875.03	红塔证券股份有限公司
114	三门峡市投资集团有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具	97.39	中信银行股份有限公司
115	厦门国贸控股集团有限公司 2026 年度第四期中期票据(品种一)	119.67	交通银行股份有限公司
116	厦门象屿集团有限公司 2026 年度第二期中期票据(品种二)	119.76	中信银行股份有限公司
117	山东高速集团有限公司 2023 年度第七期中期票据	5.64	中信银行股份有限公司
118	山东高速集团有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行永续期公司债券(第四期)(可持续挂钩)	129.17	国信证券股份有限公司
119	山东高速集团有限公司 2024 年度第二期中期票据	7.79	兴业银行股份有限公司
120	山东高速集团有限公司 2024 年度第三期中期票据	12.19	兴业银行股份有限公司
121	山东高速集团有限公司 2024 年度第五期中期票据	23.69	兴业银行股份有限公司
122	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永续期公司债券(第二期)	11.29	国信证券股份有限公司
123	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永续期公司债券(第三期)	11.28	国信证券股份有限公司
124	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永续期公司债券(第四期)	5.58	国信证券股份有限公司
125	山东高速集团有限公司 2025 年度第四期中期票据	9.02	兴业银行股份有限公司
126	山东省融担供应链科技有限公司 2025 年度第一期产业集合供应链票据定向资产支持票据优先级	113.43	中信银行股份有限公司
127	山西焦煤集团有限责任公司 2025 年度第三期中期票据	13.34	兴业银行股份有限公司
128	陕西煤业化工集团有限责任公司 2025 年度第四期中期票据	120.57	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限

			公司
129	陕西延长石油(集团)有限责任公司 2024 年度第十期中期票据	16.96	兴业银行股份有限公司
130	上海金桥出口加工区开发股份有限公司 2023 年度第一期中期票据	4.69	交通银行股份有限公司
131	上海临港经济发展(集团)有限公司 2023 年度第二期中期票据	195.14	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
132	上海能源科技发展有限公司 2023 年度第一期绿色定向资产支持票据(类 REITs/科创票据)优先级	13.48	兴业银行股份有限公司
133	上海浦东发展银行股份有限公司 2024 年第二期二级资本债券(品种一)	35.64	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
134	上海浦东发展银行股份有限公司 2024 年第一期二级资本债券(品种一)	8.98	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
135	上海浦东发展银行股份有限公司 2025 年第一期无固定期限资本债券	485.73	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
136	上海市北高新股份有限公司 2023 年度第一期中期票据	291.37	兴业银行股份有限公司
137	上海张江高科技园区开发股份有限公司 2024 年度第四期中期票据	240.18	中信银行股份有限公司
138	上饶投资控股集团有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	86.32	中信银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
139	上饶投资控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	1,065.92	中信银行股份有限公司
140	深圳弗迪融资租赁有限公司 2025 年度第三期绿色资产支持票据优先级	119.79	中信银行股份有限公司
141	声赫(深圳)商业保理有限公司 2024 年度第一期锦城定向资产支持票据优先级	242.14	兴业银行股份有限公司
142	嵊州市交通投资发展集团有限公司	132.08	国信证券股份有限公司

	司 2024 年面向专业投资者非公开发行人公司债券(第二期)		
143	十堰市城市发展控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	370.64	兴业银行股份有限公司
144	书赞桢诺国际金融有限公司 2025 年第一期中期票据(债券通)(品种一)	121.00	交通银行股份有限公司, 汇丰银行(中国)有限公司
145	蜀道投资集团有限责任公司 2022 年度第五期中期票据	1.12	华夏银行股份有限公司
146	蜀道投资集团有限责任公司 2022 年度第一期中期票据	1.12	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
147	蜀道投资集团有限责任公司 2024 年度第二十二期中期票据	3.31	交通银行股份有限公司
148	蜀道投资集团有限责任公司 2025 年度第三期超短期融资券	120.20	交通银行股份有限公司
149	蜀道投资集团有限责任公司 2025 年度第三期短期融资券	143.54	兴业银行股份有限公司
150	四川产业振兴基金投资集团有限公司 2026 年度第一期中期票据	119.67	中信银行股份有限公司
151	四川发展(控股)有限责任公司 2026 年度第一期混合型科技创新债券	120.17	交通银行股份有限公司
152	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	248.04	华夏银行股份有限公司
153	泰兴市城市投资发展集团有限公司 2025 年度第五期中期票据	122.14	交通银行股份有限公司
154	天津津南城市建设投资有限公司 2026 年度第一期短期融资券	120.89	中信银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
155	通威股份有限公司 2025 年度第一期绿色科技创新债券	121.18	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
156	桐庐县国有资本投资运营控股集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第三期)	265.08	国信证券股份有限公司

157	武汉金融控股(集团)有限公司 2023 年度第二期中期票据	368.90	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
158	武汉金融控股(集团)有限公司 2025 年度第三期中期票据	610.83	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
159	新疆城建(集团)股份有限公司 2026 年度第一期超短期融资券	340.78	中信银行股份有限公司
160	新疆伊力特实业股份有限公司 2025 年度第一期短期融资券	474.60	兴业银行股份有限公司
161	新希望六和股份有限公司 2025 年度第三期科技创新债券(乡村振兴)	95.88	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
162	兴业银行股份有限公司 2022 年 第一期二级资本债券	11.19	交通银行股份有限公司
163	兴业银行股份有限公司 2024 年 第一期二级资本债券	5.71	兴业银行股份有限公司
164	徐工集团工程机械股份有限公司 2025 年度第三期定向资产支持票 据优先 A1 级	20.71	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
165	盐城市国有资产投资集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	134.33	兴业银行股份有限公司
166	盐城市海兴集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	620.45	兴业银行股份有限公司
167	兖矿能源集团股份有限公司 2024 年度第二期中期票据(科创票据)	13.68	兴业银行股份有限公司
168	远东国际融资租赁有限公司 2025 年度第九期超短期融资券	95.76	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
169	云南省投资控股集团有限公司 2025 年度第十三期中期票据	121.40	交通银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
170	长沙银行股份有限公司 2024 年 无固定期限资本债券	244.41	兴业银行股份有限公司
171	招商局蛇口工业区控股股份有限 公司 2023 年度第二期绿色中期 票据	128.48	中信银行股份有限公司
172	浙江金汇五金产业集团有限公司	729.59	国信证券股份有限公司

	2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)		
173	浙江荣盛控股集团有限公司 2025 年度第三期短期融资券	96.24	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
174	浙江省交通投资集团有限公司 2025 年度第五期中期票据	5.52	华夏银行股份有限公司
175	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(第三期)	97.65	国信证券股份有限公司
176	浙江泰隆商业银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券	367.32	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
177	郑州银行股份有限公司 2021 年无固定期限资本债券	889.59	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
178	中电投融和融资租赁有限公司 2023 年度第六期绿色中期票据(碳中和债/专项乡村振兴)	194.63	兴业银行股份有限公司
179	中国大唐集团有限公司 2025 年度第十一期中期票据(能源保供特别债)	11.13	中信银行股份有限公司
180	中国东方航空集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	121.55	中信银行股份有限公司
181	中国东方航空集团有限公司 2025 年度第六期超短期融资券	288.36	兴业银行股份有限公司
182	中国对外经济贸易信托有限公司 2025 年度启赢 2 号第六期京东定向资产支持票据优先 A 级	390.99	国信证券股份有限公司
183	中国对外经济贸易信托有限公司 2025 年度启赢 2 号第六期京东定向资产支持票据优先 B 级	143.14	国信证券股份有限公司
184	中国工商银行股份有限公司 2021 年无固定期限资本债券(第二期)	367.59	交通银行股份有限公司
185	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)	379.70	交通银行股份有限公司
186	中国工商银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第三期)(品种一)	26.14	交通银行股份有限公司

187	中国工商银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第四期)(品种一)	40.75	交通银行股份有限公司
188	中国工商银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第五期)(品种一)	8.01	交通银行股份有限公司
189	中国工商银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第一期)(品种一)	6.70	交通银行股份有限公司
190	中国工商银行股份有限公司 2024 年二级资本债券(第二期)(债券通)	2.25	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
191	中国工商银行股份有限公司 2024 年总损失吸收能力非资本债券(第一期)(品种一)	33.75	国信证券股份有限公司
192	中国工商银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)(债券通)	486.12	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
193	中国光大银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第一期)(品种一)	59.17	交通银行股份有限公司
194	中国国新控股有限责任公司 2022 年度第三期中期票据(能源保供特别债)	3.39	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
195	中国国新控股有限责任公司 2022 年度第五期中期票据(能源保供特别债)	19.19	华夏银行股份有限公司
196	中国华电集团有限公司 2023 年度第八期中期票据(品种二)	6.73	兴业银行股份有限公司
197	中国华电集团有限公司 2023 年度第七期中期票据(品种二)	33.62	兴业银行股份有限公司
198	中国华电集团有限公司 2025 年度第二期中期票据(品种一)	16.69	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
199	中国华电集团有限公司 2025 年度第三期中期票据(品种一)	7.80	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
200	中国华电集团有限公司 2025 年度第五期中期票据(能源保供特别债)	6.65	中信银行股份有限公司
201	中国华电集团有限公司 2025 年度第一期中期票据(能源保供特别	25.60	中信银行股份有限公司, 兴业股份有限



	债)		公司
202	中国华电科工集团有限公司 2025 年度第一期科技创新债券	479.40	兴业银行股份有限公司
203	中国华能集团有限公司 2025 年度第六期中期票据(能源保供特别债)	11.07	中信银行股份有限公司
204	中国华能集团有限公司 2025 年度第五期中期票据(能源保供特别债)	3.33	中信银行股份有限公司
205	中国建设银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第二期)(品种一)	24.91	交通银行股份有限公司
206	中国建设银行股份有限公司 2022 年无固定期限资本债券(第一期)	33.06	国信证券股份有限公司
207	中国建设银行股份有限公司 2024 年总损失吸收能力非资本债券(第一期)(品种一)	27.87	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
208	中国建筑第八工程局有限公司 2023 年度第一期中期票据(科创票据)	389.77	兴业银行股份有限公司
209	中国建筑第六工程局有限公司 2025 年度第二期科技创新债券	95.77	交通银行股份有限公司
210	中国建筑第七工程局有限公司 2024 年度第一期中期票据(科创票据)	41.29	兴业银行股份有限公司
211	中国建筑第五工程局有限公司 2024 年度第二期中期票据(科创票据)	13.75	中信银行股份有限公司
212	中国民生银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券(第一期)	610.56	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
213	中国民生银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)	243.85	兴业银行股份有限公司
214	中国五矿集团有限公司 2024 年度第二期中期票据(品种二)	11.19	中信银行股份有限公司
215	中国五矿集团有限公司 2024 年度第二期中期票据(品种一)	5.59	中信银行股份有限公司

216	中国五矿集团有限公司 2024 年度第五期中期票据(品种二)	5.64	中信银行股份有限公司
217	中国五矿集团有限公司 2024 年度第一期中期票据(品种一)	16.98	兴业银行股份有限公司
218	中国五矿集团有限公司 2025 年度第八期中期票据	11.30	中信银行股份有限公司
219	中国五矿集团有限公司 2025 年度第二十四期中期票据(并购)	1,193.59	中信银行股份有限公司
220	中国五矿集团有限公司 2025 年度第九期中期票据	4.46	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
221	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)	734.07	交通银行股份有限公司
222	中国冶金科工股份有限公司 2023 年度第十期中期票据	34.76	华夏银行股份有限公司
223	中国银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第二期)(品种一)	62.32	交通银行股份有限公司
224	中国银行股份有限公司 2024 年总损失吸收能力非资本债券(第一期)(品种一)	14.62	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
225	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)	613.50	交通银行股份有限公司
226	中国邮政集团有限公司 2024 年度第八期中期票据	17.87	兴业银行股份有限公司
227	中国邮政集团有限公司 2024 年度第十期中期票据	3.34	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
228	中国邮政集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	23.63	中信银行股份有限公司
229	中建投融资租赁(上海)有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	110.09	兴业银行股份有限公司
230	中交城市投资控股有限公司 2023 年度第一期中期票据(可持续挂钩)	7.50	兴业银行股份有限公司

231	中交第一航务工程局有限公司 2024 年度第三期定向资产支持票 据(科创票据)优先级	12.95	兴业银行股份有限公司
232	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	265.51	交通银行股份有限公司
233	中信银行股份有限公司 2025 年 二级资本债券(第一期)(债券通)	22.33	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
234	中央汇金投资有限责任公司 2025 年度第六期中期票据	5.54	交通银行股份有限公司
235	中盈万家 2021 年第三期个人住 房抵押贷款资产支持证券优先 A- 3 档资产支持证券	2.35	交通银行股份有限公司
236	重庆迈瑞城市建设投资有限责任 公司 2021 年度第一期定向债务 融资工具	117.10	中信银行股份有限公 司, 交通银行股份有限 公司
237	重庆三峡银行股份有限公司 2023 年"三农"专项金融债券	723.23	兴业银行股份有限公司
238	重庆市涪陵国有资产投资经营集 团有限公司 2023 年度第二期定 向债务融资工具	246.32	交通银行股份有限公司
239	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)	488.51	国信证券股份有限公司
240	舟山海城建设投资集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发 行公司债券(第二期)	66.27	国信证券股份有限公司
241	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)	130.75	国信证券股份有限公司
242	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)	269.35	国信证券股份有限公司
243	珠海大横琴集团有限公司 2021 年度第二期绿色中期票据	129.14	中信银行股份有限公司
244	珠海九洲控股集团有限公司 2024	273.69	交通银行股份有限公司

	年度第二期中期票据		
245	淄博市城市资产运营集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第三期)(品种二)	292.40	国信证券股份有限公司
246	淄博市城市资产运营有限公司 2022 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)(品种二)	202.99	国信证券股份有限公司

### 三、投资运作分析

#### 3.1 基本情况。

期末产品份额总额为 4,890,993,603.12 份，产品单位净值为 1.0600，产品单位累计净值为 1.0600，产品资产净值为 5,184,913,139.45 元，期末杠杆水平为 104.32%。今年以来年化收益率<sup>1</sup>为 1.8834%。

#### 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

26 年 1 月初，股市强势上攻压制债市情绪，叠加政府债发行规模较大且 12 月 PMI 超市场预期，10 年国债收益率快速上行逼近 1.9%关口；中下旬监管上调融资保证金比例带动股市行情降温，且在发改委、财政部陆续召开新闻发布会背景下政策不确定性有所降低，叠加央行超量续作买断式逆回购和 MLF，并多次提及“年内降准降息仍有空间”，债市情绪好转震荡修复，10 年国债收益率下行接近 1.8%关口。2 月春节假期影响叠加宏

<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%(结果保留 4 位小数，四舍五入。)

统计日：取 2026 年 3 月 31 日(含)之前最新可得【累计单位净值】所对应的日期。

基准日：取 2025 年年末最后一个自然日与【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。)

观数据空窗期，债市走势缺乏明确主线，10 年国债围绕 1.80% 点位宽幅震荡。月初债市震荡走强，节前资金平稳且有持券过节配置需求支撑，10 年国债一度触及 1.77% 且超长债下行较多；节后权益市场走强叠加上海地产新政出台，债市止盈情升温，10 年国债重新站上 1.81%，超长债亦有所上行。3 月债市主线围绕地缘冲突推升通胀预期叠加经济基本面数据改善，10 年国债收益率上破 1.83 点位后整理，长端国债品种收益率整体上行，30-10 年国债利差走阔至 2022 年中以来最高水平，收益率曲线走陡。短端则在资金宽松和同业活期存款利率管理升级的带动下走强。

展望第二季度，美伊局势走向难料，滞胀担忧仍将扰动长端表现，同时伴随一季度经济数据和 2026 年超长期特别国债发行计划出炉，市场也或将围绕基本面与供给情况展开博弈，预计长端呈区间震荡特征。短端方面，近日央行连续地量操作，但适度宽松的货币政策基调下资金面有望维持平稳并为短端提供支撑，同时也支撑信用品种在一季度保持强势，但目前信用利差也来到了相对低点，进一步下行空间或相对有限。

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

2026 年 4 月 22 日