

交银理财稳享灵动慧利日开 3 号（14 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 3 号（14 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000924000069）

2024 年年度定期报告公告如下：

报告期为 2024 年 1 月 18 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	5.34%	0.49%	5.83%
债权类资产	11.32%	82.85%	94.17%
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	16.66%	83.34%	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	200,269.55	5.25%
2	债券买入返售	110,000.00	2.88%
3	1003 他行存款	53,586.14	1.40%
4	1003 他行存款	48,698.32	1.28%
5	1003 他行存款	41,107.03	1.08%
6	1003 他行存款	39,196.96	1.03%
7	1003 他行存款	29,183.64	0.76%
8	YR155A	27,044.86	0.71%
9	1003 他行存款	26,335.04	0.69%
10	1003 他行存款	23,414.36	0.61%
合计		598,835.89	15.69%

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。

序号	证券代码	证券名称	报告期内交易证券		交易类型	关联方名称	关联方角色
			数量	总金额 (万元)			
1	148115	深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行科技创新公司债券(第五期)	200,000	2,049.58	债券买入	国信证券股份有限公司	债券承销
2	185814	国泰君安证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种一)	250,000	2,531.61	债券买入	国信证券股份有限公司	债券承销
3	188757	舟山交通投资集团有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	100,000	1,037.60	债券买入	国信证券股份有限公司	债券承销
4	241803	国泰君安证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行次级债券(第二期)(品种一)	400,000	4,032.94	债券买入	国信证券股份有限公司	债券承销
5	241836	国投证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第二期)	400,000	4,000.00	债券买入	国信证券股份有限公司	债券承销

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 238 号	141,510.00	资产买入	交银国际信

	集合资金信托计划			托有限公司
2	交银国信·汇利 238 号 集合资金信托计划	20,502.01	资产卖出 或到期	交银国际信 托有限公司
3	交银国信·汇利 273 号 集合资金信托计划	1,681,500.00	资产买入	交银国际信 托有限公司
4	交银国信·汇利 273 号 集合资金信托计划	792,861.41	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	191.41	交通银行股份有限公司
2	销售手续费	1,539.50	交通银行股份有限公司
3	销售手续费	16.59	中信银行股份有限公司
4	投资管理费	482.65	交银理财有限责任公司

2.4 产品发生的其他关联交易。

序号	资产名称	累计发生金 额(万元)	交 易 类 型	关联方 名称	关联 方角 色
1	2021 年第一期成都高新投资集团 有限公司公司债券	1,029.15	资 产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
2	2021 年第一期南京江北新区产业 投资集团有限公司公司债券	10,337.46	资 产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
3	国君-华泰-华能信托美憬二期 8 号资产支持专项计划优先 B 级资 产支持证券	330.98	资 产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交易 对手
4	国联-度小满消费分期 4 号 3 期 资产支持专项计划优先 B 级资产 支持证券	301.51	资 产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交易 对手
5	国联满扬 2 号 2 期资产支持专项 计划(可续发型)第 1 期次优先 B	210.89	资 产	交银理 财有限	交易 对手

	级资产支持证券		买 入	责 任 公 司	
6	国联满运 2 号中小微企业融资支持 2 期资产支持专项计划优先 A1 级资产支持证券	2,005.27	资 产 买 入	交银理财有 限责任公 司	交 易 对 手
7	国泰君安证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行次级债券(第二期)(品种一)	4,032.94	资 产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交 易 对 手
8	湖北省港口集团有限公司 2021 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)	3,099.35	资 产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交 易 对 手
9	华远国际陆港集团有限公司 2022 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)(品种一)	3,095.14	资 产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交 易 对 手
10	京东科技荟享 17 号第 1 期资产支持专项计划(可续发型)优先 B 级资产支持证券	302.16	资 产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交 易 对 手
11	京东科技荟享 17 号第 2 期资产支持专项计划(可续发型)优先 B 级资产支持证券	302.16	资 产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交 易 对 手
12	京东科技-金采 5 号 1 期保理合同债权资产支持专项计划优先级资产支持证券	9,022.87	资 产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交 易 对 手
13	京东科技-金采 5 号 3 期保理合同债权资产支持专项计划优先级资产支持证券	4,508.84	资 产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交 易 对 手
14	京东科技-金采 5 号 5 期保理合同债权资产支持专项计划优先级资产支持证券	4,832.75	资 产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交 易 对 手

15	开封国有资产投资经营集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)	5,134.53	资产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交易 对手
16	溧阳市城市建设发展集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行短期公司债券(第一期)	7,050.52	资产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交易 对手
17	临沂城市建设投资集团有限公司 2022 年非公开发行公司债券(第一期)	8,174.75	资产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
18	南京江北新区公用控股集团有限公司 2023 年公开发行公司债券 (第一期)	6,301.74	资产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
19	衢州市国有资本运营有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行 公司债券(第二期)(品种一)	2,026.42	资产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交易 对手
20	上海奉贤交通能源(集团)有限公司公开发行 2020 年公司债券(第 一期)	1,010.25	资产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
21	上海张江(集团)有限公司公开发 行 2021 年公司债券(第一期)	1,038.15	资产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
22	绍兴市镜湖新区开发集团有限公 司 2019 年非公开发行公司债券 (第二期)	3,640.20	资产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
23	苏州市吴中国裕资产经营有限公 司 2021 年非公开发行公司债券 (第一期)	4,148.89	资产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
24	台州市椒江区国有资本运营集团 有限公司 2021 年公开发行公司债	5,029.42	资产	交银国 际信托	交易 对手

	券(第一期)(面向专业投资者)(品种一)		买入	有限公司	
25	温州市鹿城区城市发展集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)	5,253.17	资产 买入	交银国际信托有限公司	交易对手
26	扬州经济技术开发区开发(集团)有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行短期公司债券(第二期)	4,023.06	资产 买入	交银理财有限责任公司	交易对手
27	宜昌城市发展投资集团有限公司 2022 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)	2,041.81	资产 买入	交银国际信托有限公司	交易对手
28	耘睿 13 号第 5 期资产支持专项计划(可续发型)第 1 期次优先 A 级资产支持证券	6,037.99	资产 买入	交银国际信托有限公司	交易对手
29	耘睿 15 号第 4 期资产支持专项计划优先 B 级资产支持证券	501.57	资产 买入	交银理财有限责任公司	交易对手
30	耘睿 15 号第 5 期资产支持专项计划优先 B 级资产支持证券	300.88	资产 买入	交银理财有限责任公司	交易对手
31	招商证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行次级债券(第三期)(品种二)	5,206.02	资产 买入	交银国际信托有限公司	交易对手
32	招商证券-华能太泽 7 期资产支持专项计划优先 A1 级资产支持证券	2,208.20	资产 买入	交银国际信托有限公司	交易对手
33	招商证券-美誉心诚 2 号第 3 期资产支持专项计划优先 B 级资产支持证券	100.70	资产 买入	交银理财有限责任公司	交易对手

34	浙江安吉国控建设发展集团有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	4,134.07	资产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手
35	中国国际金融股份有限公司 2023 年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)	1,021.30	资产 买 入	银河基 金管理 有限公 司	交易 对手
36	中金-耀月 16 期资产支持专项计划优先 A 级资产支持证券	4,149.57	资产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交易 对手
37	中信证券-圆满 1 号第 4 期资产支持专项计划优先 B 级资产支持证券	301.13	资产 买 入	交银理 财有限 责任公 司	交易 对手
38	重庆市涪陵国有资产投资经营集团有限公司 2020 年非公开发行公司债券(第一期)(品种二)	4,695.46	资产 买 入	交银国 际信托 有限公 司	交易 对手

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	2018 年第二期中国东方资产管理股份有限公司金融债券(债券通)品种三	10,956.53	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
2	2018 年第一期中国东方资产管理股份有限公司金融债券(债券通)品种二	1,097.25	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
3	2021 年成都东方广益投资有限公司公司债券(第二期)(品种一)	500.93	国信证券股份有限公司
4	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	518.88	国信证券股份有限公司

5	2024 年安徽省政府再融资专项 债券(十八期)	4,899.44	交通银行股份有限公司
6	2024 年安徽省政府再融资专项 债券(十七期)	983.16	交通银行股份有限公司
7	2024 年河南省政府再融资专项 债券(十八期)-2024 年河南省政 府专项债券(七十三期)	9,798.82	交通银行股份有限公司
8	2024 年河南省政府再融资专项 债券(十七期)-2024 年河南省政 府专项债券(七十二期)	11,308.13	交通银行股份有限公司
9	北京京东世纪贸易有限公司 2024 年度东裕 4 号京东白条第 一期定向资产支持票据优先 A 级	341.63	中信银行股份有限公司
10	曹妃甸国控投资集团有限公司 2024 年度第三期中期票据	502.61	交通银行股份有限公司
11	常德市城市建设投资集团有限公 司 2022 年度第二期定向债务融 资工具	505.03	中信银行股份有限公 司，华夏银行股份有限 公司
12	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)	2,544.32	交通银行股份有限公司
13	常德市城市建设投资集团有限公 司 2023 年度第四期定向债务融 资工具	1,015.87	兴业银行股份有限公司
14	常州市晋陵投资集团有限公司 2022 年面向专业投资者公开发 行公司债券(第二期)	1,994.93	国信证券股份有限公司
15	成都经开国投集团有限公司 2021 年度第二期中期票据	507.70	兴业银行股份有限公司
16	成都经开国投集团有限公司 2021 年度第一期中期票据	1,542.37	兴业银行股份有限公司
17	城发投资集团有限公司 2023 年 度第三期中期票据	750.59	交通银行股份有限公司
18	城发投资集团有限公司 2024 年 度第一期中期票据	1,024.82	中信银行股份有限公 司，交通银行股份有限 公司
19	甘肃金融控股集团有限公司 2024 年度第二期超短期融资券	4,962.32	兴业银行股份有限公司

20	甘肃省国有资产投资集团有限公司 2024 年度第三期中期票据	5,047.28	兴业银行股份有限公司
21	广西北部湾投资集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	7,586.23	兴业银行股份有限公司
22	贵州高速公路集团有限公司 2024 年度第十四期中期票据	707.53	中信银行股份有限公司，交通银行股份有限公司
23	国泰君安证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行次级债券(第二期)(品种二)	2,950.38	国信证券股份有限公司
24	国银金融租赁股份有限公司 2024 年第一期金融债券(债券通)	1,504.23	交通银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
25	海安开发区建设投资有限公司 2024 年度第四期超短期融资券	4,462.45	兴业银行股份有限公司
26	海安开发区建设投资有限公司 2024 年度第四期短期融资券	1,011.27	兴业银行股份有限公司
27	杭州滨江房产集团股份有限公司 2024 年度第六期短期融资券	4,951.77	交通银行股份有限公司
28	杭州上城区城市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(第三期)	2,520.67	国信证券股份有限公司
29	河钢集团有限公司 2023 年度第七期中期票据	1,024.48	华夏银行股份有限公司
30	河钢集团有限公司 2023 年度第十二期中期票据	4,572.72	中信银行股份有限公司
31	河钢集团有限公司 2023 年度第一期绿色中期票据(科创票据)	526.70	兴业银行股份有限公司
32	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)	995.37	国信证券股份有限公司
33	恒力石化股份有限公司 2024 年度第一期短期融资券(科创票据)	5,051.41	兴业银行股份有限公司
34	湖北宏泰集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	5,036.90	中信银行股份有限公司
35	湖州莫干山高新集团有限公司 2024 年度第三期中期票据	1,995.66	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司

			公司
36	淮安开发控股有限公司 2024 年度第三期超短期融资券	495.37	中信银行股份有限公司
37	淮安开发控股有限公司 2024 年度第五期定向债务融资工具	3,468.80	中信银行股份有限公司
38	淮安新城投资开发集团有限公司 2024 年度第六期中期票据	1,511.05	兴业银行股份有限公司
39	惠益 2019 年第五期个人住房抵押贷款优先 A-2 级资产支持证券	62.97	中信银行股份有限公司
40	吉安城投控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	2,542.54	中信银行股份有限公司
41	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	1,018.48	中信银行股份有限公司
42	江苏高淳经济开发区开发集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	509.98	兴业银行股份有限公司
43	江苏金坛投资控股有限公司 2023 年度第二期中期票据	2,041.38	兴业银行股份有限公司
44	江苏开晟产业发展集团有限公司 2024 年度第三期中期票据	2,483.51	兴业银行股份有限公司
45	江苏武进经济发展集团有限公司 2024 年度第三期中期票据	4,028.22	兴业银行股份有限公司
46	金华金开国有资本控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	1,465.15	兴业银行股份有限公司
47	金元-国君-科学城租赁大湾区产融结合资产支持专项计划优先 A1 资产支持证券	213.05	金元证券股份有限公司
48	金元-国君-科学城租赁大湾区产融结合资产支持专项计划优先 A2 资产支持证券	213.09	金元证券股份有限公司
49	临沂城市发展集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	4,030.90	兴业银行股份有限公司
50	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)	2,023.93	国信证券股份有限公司
51	南昌市政公用集团有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)	3,436.25	国信证券股份有限公司

52	南京高淳国有资产经营控股集团有限公司 2024 年度第二期短期融资券	3,981.89	中信银行股份有限公司
53	南京高淳国有资产经营控股集团有限公司 2024 年度第四期超短期融资券	495.45	中信银行股份有限公司
54	宁波市中浦石化投资集团有限公司 2021 年度第一期绿色中期票据	496.55	交通银行股份有限公司
55	平安国际融资租赁有限公司 2023 年度第二期中期票据	1,005.58	兴业银行股份有限公司
56	平安证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第一期)	10,594.35	国信证券股份有限公司
57	平安证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)(品种二)	5,027.57	国信证券股份有限公司
58	平安证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种一)	4,427.61	国信证券股份有限公司
59	平安证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种一)	4,909.58	国信证券股份有限公司
60	平安租赁 2024 年度安新第一期定向资产支持票据优先 A2 级	1,282.60	汇丰银行(中国)有限公司
61	前联 2024 年度第二期华发优生活五号资产支持票据优先级	385.62	兴业银行股份有限公司
62	前联 2024 年度第一期华发优生活五号资产支持票据优先级	343.87	兴业银行股份有限公司
63	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)	6,096.04	国信证券股份有限公司
64	青岛胶州城市发展投资有限公司 2023 年度第一期中期票据	1,526.86	交通银行股份有限公司
65	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)	978.98	国信证券股份有限公司

66	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)	492.38	国信证券股份有限公司
67	日照城投集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	5,063.66	中信银行股份有限公司
68	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	3,072.21	兴业银行股份有限公司
69	三一集团有限公司 2024 年度第一期短期融资券(科创票据)	498.84	交通银行股份有限公司
70	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公司债券(第四期)	5,011.38	国信证券股份有限公司
71	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可续期公司债券(第四期)	495.88	国信证券股份有限公司
72	陕西延长石油(集团)有限责任公司 2022 年度第三期中期票据	995.69	兴业银行股份有限公司
73	上海国际信托有限公司 2024 年度惠鸿第二期定向资产支持票据 优先 A1 档	2,477.50	中信银行股份有限公司
74	上海国际信托有限公司 2024 年度惠鸿第三期定向资产支持票据 优先 A1 档	5,449.60	中信银行股份有限公司
75	上海国际信托有限公司 2024 年度惠鸿第三期定向资产支持票据 优先 A2 档	1,585.51	中信银行股份有限公司
76	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)	988.11	国信证券股份有限公司
77	绍兴市城市建设投资集团有限公司 2020 年度第一期定向债务融资工具(疫情防控债)	1,012.53	兴业银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
78	绍兴市城市建设投资集团有限公司 2021 年非公开发行公司债券(第一期)	1,037.41	国信证券股份有限公司
79	绍兴市越城区城市发展建设集团	1,030.79	国信证券股份有限公司

	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)(品种一)		
80	深圳前海联易融商业保理有限公司 2024 年度第三期招信供应链定向资产支持票据优先级	256.95	中信银行股份有限公司
81	深圳前海联易融商业保理有限公司 2024 年度第一期和瑞资产支持票据优先级	4,971.18	交通银行股份有限公司
82	声赫(深圳)商业保理有限公司 2024 年度第二期蜀信定向资产支持票据优先级	436.65	中信银行股份有限公司
83	声赫(深圳)商业保理有限公司 2024 年度第一期蜀信定向资产支持票据优先级	263.21	中信银行股份有限公司
84	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(第二期)	5,697.76	国信证券股份有限公司
85	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)	5,171.17	国信证券股份有限公司
86	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)	495.94	国信证券股份有限公司
87	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)	1,498.63	国信证券股份有限公司
88	水发集团有限公司 2024 年度第七期中期票据	1,974.67	交通银行股份有限公司
89	苏州市吴中灵天建设投资发展有限公司 2022 年度第二期中期票据	1,505.77	中信银行股份有限公司
90	天津滨海新区建设投资集团有限公司 2024 年度第五期超短期融资券	4,956.62	交通银行股份有限公司
91	天津城市基础设施建设投资集团有限公司 2024 年度第二十一期中期票据	1,997.26	华夏银行股份有限公司

92	天津轨道交通集团有限公司 2024 年度第九期超短期融资券	4,952.25	华夏银行股份有限公司
93	天津轨道交通集团有限公司 2024 年度第五期超短期融资券	4,954.92	兴业银行股份有限公司
94	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)	5,515.95	国信证券股份有限公司
95	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)	1,978.35	国信证券股份有限公司
96	望城经开区投资建设集团有限公 司 2022 年度第二期中期票据	498.59	华夏银行股份有限公司
97	芜湖市建设投资有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司 债券(第一期)	1,029.43	国信证券股份有限公司
98	武汉金融控股(集团)有限公司 2023 年度第三期中期票据	508.98	中信银行股份有限公司
99	西安高新控股有限公司 2023 年 度第五期定向债务融资工具	1,011.40	中信银行股份有限公司
100	宣城市国有资产投资有限公司 2022 年度第四期中期票据	996.28	兴业银行股份有限公司
101	盐城市城市资产投资集团有限公 司 2022 年度第三期定向债务融 资工具	1,018.19	中信银行股份有限公司
102	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(第二期)	511.07	国信证券股份有限公司
103	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)	988.06	国信证券股份有限公司
104	伊犁哈萨克自治州财通国有资产 经营有限责任公司 2024 年度第 三期超短期融资券	1,983.09	交通银行股份有限公司
105	宜春交通投资集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	1,010.59	兴业银行股份有限公司
106	永赢金融租赁有限公司 2023 年	1,001.63	中信银行股份有限公

	金融债券		司，兴业银行股份有限公司
107	永赢金融租赁有限公司 2024 年 金融债券(第三期)	5,493.25	中信银行股份有限公司， 兴业银行股份有限公司
108	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)	712.74	国信证券股份有限公司
109	云南省能源投资集团有限公司 2024 年度第十期中期票据	5,005.62	兴业银行股份有限公司
110	云南省能源投资集团有限公司 2024 年度第十一期中期票据	5,026.02	中信银行股份有限公司
111	云南省投资控股集团有限公司 2024 年度第十二期中期票据	4,928.93	交通银行股份有限公司
112	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)	2,028.70	国信证券股份有限公司
113	浙江龙盛集团股份有限公司 2024 年度第一期中期票据(科创 票据)	2,975.11	兴业银行股份有限公司
114	镇江城市建设产业集团有限公司 2023 年度第四期中期票据	1,024.20	兴业银行股份有限公司
115	知识城(广州)投资集团有限公司 2024 年度第二期超短期融资券	493.29	中信银行股份有限公司
116	中国对外经济贸易信托有限公司 2024 年度第二期启赢 1 号京东定 向资产支持票据优先 A 级	427.34	国信证券股份有限公司
117	中国工商银行股份有限公司 2020 年二级资本债券(第一期)	768.76	交通银行股份有限公司
118	中国水利水电第四工程局有限公 司 2024 年度第一期中期票据(科 创票据)	4,390.77	交通银行股份有限公司
119	中国银河证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公 司债券(第二期)(品种二)	5,080.92	国信证券股份有限公司
120	中国银河证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发 行次级债券(第二期)(品种二)	5,019.16	国信证券股份有限公司

121	中国银河证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发 行次级债券(第二期)(品种一)	2,494.40	国信证券股份有限公司
122	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	596.96	兴业银行股份有限公司
123	中山城市建设集团有限公司 2021 年面向合格投资者公开发行公司 债券(第一期)	1,486.44	国信证券股份有限公司
124	中铁四局集团有限公司 2024 年 度第三期两新保供稳链资产支持 票据(科创票据)优先级	862.54	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
125	重庆市涪陵区新城区开发(集团) 有限公司 2022 年度第二期定向 债务融资工具	2,051.82	中信银行股份有限公 司，华夏银行股份有限 公司
126	舟山交通投资集团有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司 债券(第二期)	1,020.81	国信证券股份有限公司
127	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)	1,002.16	国信证券股份有限公司
128	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)	1,006.08	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 36,323,950,630.36 份，产品单位净值为 1.0383，产品单位累计净值为 1.0383，产品资产净值为 37,718,618,470.52 元，期末杠杆水平为 101%。今年以来年化收益率¹为 4.0056%。

¹ 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

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

展望未来，经济预计延续改善向好。稳增长诉求增强、宏观政策加码的背景下，财政仍将加力提效来托底基建。存量政策的传导及后续增量政策的推出有助于需求端逐步打开空间，缓解供需结构的不平衡。出口中短期仍具备一定韧性，但外部环境不确定性增加，内需将成为推动经济增长的重要动力，货币政策有望延续支持性的立场，资金面预计维持平稳宽松态势，对应债市或呈现震荡偏强的态势。

本产品将根据不同资产收益率的动态变化，适时调整组合结构，根据期限利差、流动性预期动态调整组合杠杆率，通过对市场利率的前瞻性判断进行合理有效的久期管理，严格控制信用风险、流动性风险和利率风险，努力为持有人创造稳健的收益。

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

【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）。

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