

交银理财稳享固收精选日开 2 号（60 天持有期）理财产品定期报告（2024 年年度）

尊敬的客户：

我司交银理财稳享固收精选日开 2 号（60 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000921000175）

2024 年年度定期报告公告如下：

报告期为 2024 年 1 月 1 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	5.56%	1.28%	6.84%
债权类资产	21.73%	66.96%	88.68%
权益类资产	0.00%	4.47%	4.47%
商品及金融衍生品类	0.00%	0.00%	0.00%
合计	27.29%	72.71%	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	49,380.11	5.54%
2	平安银行股份有限公司 2024 年第 062 期同业存单	24,919.59	2.79%
3	活期存款	11,443.13	1.28%
4	景顺长城景颐双利债券型证券投资基金	11,438.34	1.28%
5	中泰证券股份有限公司公开发行 2022 年公司债券(第一期)	10,290.34	1.15%
6	长盛安鑫中短债债券型证券投资基金	10,168.72	1.14%
7	天弘优利短债债券型发起式证券投资基金	10,163.29	1.14%
8	长盛盛裕纯债债券型证券投资基金	10,072.23	1.13%
9	申万菱信安泰瑞利中短债债券型证券投资基金	10,035.00	1.12%
10	广发景明中短债债券型证券投资基金	10,025.99	1.12%
合计		157,936.75	17.70%

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 200 号 集合资金信托计划	48,803.97	资产卖出 或到期	交银国际信托有 限公司
2	交银国信·汇利 201 号 集合资金信托计划	20,000.00	资产买入	交银国际信托有 限公司
3	交银国信·聚通稳健 1 号集合资金信托计划	69,800.00	资产买入	交银国际信托有 限公司
4	交银国信·聚通稳健 1 号集合资金信托计划	118,157.10	资产卖出 或到期	交银国际信托有 限公司
5	交银施罗德稳利中短债 债券型证券投资基金	5,000.00	资产买入	交银施罗德基金 管理有限公司
6	交银施罗德资管卓远 1 号集合资产管理计划	7,200.38	资产卖出 或到期	交银施罗德资产 管理有限公司
7	交银施罗德资管卓远 2 号集合资产管理计划	109,278.22	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	托管费	222.34	交通银行股份有限公司
2	销售手续费	1,553.65	交通银行股份有限公司
3	销售手续费	10.99	兴业银行股份有限公司
4	销售手续费	42.08	中信银行股份有限公司
5	投资管理费	1,667.56	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	2024 年安徽省政府再融资专项 债券(十七期)	1,042.35	交通银行股份有限公司
2	2024 年福建省高质量发展专项 债券(二十期)-2024 年福建省政 府专项债券(二十七期)	432.46	交通银行股份有限公司 ， 兴业银行股份有限 公司
3	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)	35.21	交通银行股份有限公司
4	2024 年湖北省政府再融资专项 债券(二十一期)	1,486.02	交通银行股份有限公司 ， 兴业银行股份有限 公司
5	2024 年湖南省地方政府再融资 专项债券(十二期)	615.63	交通银行股份有限公司
6	2024 年江西省地方政府再融资 专项债券(十七期)	26.33	交通银行股份有限公司 ， 兴业银行股份有限 公司
7	2024 年厦门市地方政府再融资 专项债券(四期)	569.85	交通银行股份有限公司 ， 兴业银行股份有限 公司
8	2024 年山东省地方政府再融资 专项债券(十一期)	906.96	交通银行股份有限公司
9	2024 年浙江省其他项目收益专 项债券(三十七期)-2024 年浙江 省政府专项债券(四十六期)	284.89	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
10	安信证券股份有限公司 2022 年 面向专业投资者非公开发行公司 债券(第一期)(品种一)	18.14	国信证券股份有限公司
11	蚌埠市城市投资控股有限公司 2023 年度第五期定向债务融资工 具	1,024.90	兴业银行股份有限公司
12	保利发展控股集团股份有限公司 2020 年度第三期中期票据	1,539.68	兴业银行股份有限公司

13	北京海开控股(集团)股份有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	0.31	华夏银行股份有限公司
14	滨州市财金投资集团有限公司 2024 年度第二期中期票据(品种一)	35.17	华夏银行股份有限公司
15	常德市德源投资集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	18.07	兴业银行股份有限公司
16	成都经开国投集团有限公司 2021 年度第二期中期票据	1,034.35	兴业银行股份有限公司
17	成都市新都香城建设投资有限公司 2024 年度第一期超短期融资券	35.40	兴业银行股份有限公司
18	滁州市城市投资控股集团有限公司 2022 年度第三期中期票据	1,158.06	中信银行股份有限公司
19	滁州市城市投资控股集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	9.05	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
20	东槌 2024 年度 1 号第二期定向资产支持票据优先 A 级	47.53	国信证券股份有限公司
21	东槌 2024 年度 1 号第二期定向资产支持票据优先 B 级	2.63	国信证券股份有限公司
22	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(第一期)	18.10	国信证券股份有限公司
23	贵州交通建设集团有限公司 2022 年度第五期中期票据	573.26	交通银行股份有限公司
24	国家电投-湖北电力清洁能源绿色碳中和资产支持专项计划(类 REITs)优先级资产支持证券	0.31	国信证券股份有限公司
25	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)	44.01	国信证券股份有限公司
26	国信证券股份有限公司非公开发行 2020 年永续次级债券(第二期)	2,579.85	国信证券股份有限公司
27	国信证券股份有限公司非公开发行 2020 年永续次级债券(第一期)	969.65	国信证券股份有限公司
28	国药控股(中国)融资租赁有限公	524.29	兴业银行股份有限公司

	司 2022 年度第一期中期票据		
29	海安开发区建设投资有限公司 2024 年度第五期定向债务融资 工具	35.38	中信银行股份有限公司
30	海尔集团(青岛)金盈控股有限公司 2024 年度第四期中期票据	503.46	兴业银行股份有限公司
31	杭州市临安区城市发展投资集团 有限公司 2020 年非公开发行公 司债券(第一期)	346.74	国信证券股份有限公司
32	杭州余杭城市发展投资集团有限 公司 2022 年度第六期定向债务 融资工具	191.16	中信银行股份有限公 司，交通银行股份有限 公司
33	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	380.58	中信银行股份有限公 司，交通银行股份有限 公司
34	合肥兴泰金融控股(集团)有限公 司 2024 年度第一期中期票据	8.77	中信银行股份有限公 司，兴业银行股份有限 公司
35	菏泽投资发展集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	1,010.02	交通银行股份有限公司
36	恒丰银行股份有限公司 2020 年 无固定期限资本债券	225.84	交通银行股份有限公司
37	恒丰银行股份有限公司 2022 年 无固定期限资本债券	94.92	交通银行股份有限公司
38	横琴金投租赁知识产权第三期资 产支持专项计划优先级资产支持 证券	0.04	金元证券股份有限公司
39	湖州市产业投资发展集团有限公 司 2024 年度第一期定向债务融 资工具(科创票据)	45.71	中信银行股份有限公司
40	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 A 级	88.13	中信银行股份有限公司
41	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	2.64	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 年度第二期中期票	2,534.01	兴业银行股份有限公司

	据		
43	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	1,543.16	兴业银行股份有限公司
44	淮安市投资控股集团有限公司 2024 年度第三期中期票据	1,036.73	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
45	淮北市建投控股集团有限公司 2023 年度第三期定向债务融资工具	305.66	兴业银行股份有限公司
46	淮北市建投控股集团有限公司 2024 年度第七期中期票据	509.76	兴业银行股份有限公司
47	淮北市建投控股集团有限公司 2024 年度第十期中期票据	1,008.20	兴业银行股份有限公司
48	嘉善经济技术开发区实业有限公司 2021 年度第一期定向债务融资工具	27.80	华夏银行股份有限公司
49	嘉善县国有资产投资集团有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具	1,581.69	中信银行股份有限公司
50	建安投资控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	98.19	中信银行股份有限公司，交通银行股份有限公司
51	建安投资控股集团有限公司 2024 年度第五期定向债务融资工具	502.78	中信银行股份有限公司
52	江苏创鸿资产管理有限公司 2024 年度第一期超短期融资券	502.42	中信银行股份有限公司
53	江苏盛泽投资有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	88.54	中信银行股份有限公司
54	靖江市滨江新城投资开发有限公司 2024 年度第一期中期票据	1,513.80	兴业银行股份有限公司
55	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	26.53	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
56	凯德商用产业财资有限公司	62.18	汇丰银行(中国)有限公

	2024 年度第二期定向债务融资工具(可持续挂钩/债券通)		司
57	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	45.98	中信银行股份有限公司
58	乐清市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(第一期)	44.41	国信证券股份有限公司
59	乐山国有资产投资运营(集团)有限公司 2023 年度第一期定向债务融资工具(品种二)	526.47	中信银行股份有限公司
60	立讯精密工业股份有限公司 2024 年度第四期超短期融资券	107.38	中信银行股份有限公司
61	连云港市城建控股集团有限公司 2022 年度第四期定向债务融资工具	507.66	华夏银行股份有限公司
62	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(第一期)(品种一)	8.99	国信证券股份有限公司
63	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	9.13	交通银行股份有限公司
64	南京汤山建设投资发展有限公司 2022 年非公开发行公司债券(第一期)	27.51	国信证券股份有限公司
65	南宁产业投资集团有限责任公司 2024 年度第二期中期票据	5,033.25	中信银行股份有限公司，交通银行股份有限公司
66	南阳投资集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	2,533.03	中信银行股份有限公司，华夏银行股份有限公司
67	平安国际融资租赁有限公司 2024 年度第四期短期融资券	268.33	中信银行股份有限公司
68	平顶山发展投资控股集团有限公司 2022 年度第二期中期票据	9.01	华夏银行股份有限公司
69	平湖市城市发展投资(集团)有限公司 2021 年度第三期中期票据	1,510.84	兴业银行股份有限公司，国信证券股份有限公司

70	平湖市国有资产控股集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)(品种一)	299.95	国信证券股份有限公司
71	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(第三期)(品种一)	44.82	国信证券股份有限公司
72	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)	96.59	国信证券股份有限公司
73	青岛西海岸新区融合控股集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	1,530.35	中信银行股份有限公司
74	陕西投资集团有限公司 2020 年度第一期中期票据	283.17	兴业银行股份有限公司
75	上海临港经济发展(集团)有限公司 2023 年度第二期中期票据	2,061.03	中信银行股份有限公司，交通银行股份有限公司
76	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(第二期)	9.35	国信证券股份有限公司
77	绍兴市上虞杭州湾经开区控股集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第三期)	17.85	国信证券股份有限公司
78	绍兴市越城区城市发展建设集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)(品种一)	56.03	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)	64.09	国信证券股份有限公司
80	声赫保理-韶光 1 期资产支持专项计划优先级资产支持证券	0.15	金元证券股份有限公司
81	嵊州市交通投资发展集团有限公司 2024 年度第三期定向债务融资工具	3,041.23	中信银行股份有限公司

82	嵊州市投资控股有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	18.10	国信证券股份有限公司
83	嵊州市投资控股有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	18.37	国信证券股份有限公司
84	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)	26.47	国信证券股份有限公司
85	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	8.96	交通银行股份有限公司
86	苏州苏高新集团有限公司 2022 年度第三期中期票据(科创票据)	2,540.89	中信银行股份有限公司
87	苏州吴中经开国有资本投资控股集团有限公司 2024 年度第二期定向债务融资工具	44.39	交通银行股份有限公司
88	太原市龙城发展投资集团有限公司 2024 年度第六期定向债务融资工具(品种一)	1,507.55	兴业银行股份有限公司
89	泰兴市城市投资发展集团有限公司 2022 年度第三期定向债务融资工具	511.45	华夏银行股份有限公司
90	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	517.87	兴业银行股份有限公司
91	泰州凤城河建设发展有限公司 2022 年度第二期中期票据	2,559.05	中信银行股份有限公司
92	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)	9.25	国信证券股份有限公司
93	桐庐县国有资本投资运营控股集团有限公司 2021 年度第二期中期票据	513.62	交通银行股份有限公司
94	温州市瓯江口开发建设投资集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	44.36	中信银行股份有限公司
95	温州市铁路与轨道交通投资集团	507.77	中信银行股份有限公司

	有限公司 2024 年度第一期中期 票据		
96	乌鲁木齐经济技术开发区建设投资 开发有限公司 2020 年度第一 期中期票据	9.17	华夏银行股份有限公司
97	芜湖市建设投资有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	35.69	国信证券股份有限公司
98	芜湖市建设投资有限公司公开发 行 2022 年公司债券(第二期)	44.26	国信证券股份有限公司
99	芜湖宜居投资(集团)有限公司 2022 年非公开发行公司债券(第 三期)	26.71	国信证券股份有限公司
100	武汉蔚能电池资产有限公司 2024 年度第二期绿色电池定向 资产支持票据优先级	712.66	交通银行股份有限公司
101	兴业优 1	2,824.32	兴业银行股份有限公司
102	兴业优 2	4,582.15	兴业银行股份有限公司
103	徐州高新技术产业开发区国有资 产经营有限公司 2024 年度第一 期中期票据	9.01	兴业银行股份有限公 司，国信证券股份有限 公司
104	徐州经济技术开发区国有资产经 营有限责任公司 2020 年度第二 期中期票据	9.06	兴业银行股份有限公司
105	盐城东方投资开发集团有限公司 2022 年度第二期中期票据	18.47	兴业银行股份有限公司
106	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	508.35	中信银行股份有限公司
107	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	1,589.92	中信银行股份有限公司
108	宜宾三江投资建设集团有限公司 2022 年非公开发行公司债券(第 一期)	108.94	国信证券股份有限公司
109	宜春金融控股集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开 发行公司债券(第一期)	0.16	国信证券股份有限公司
110	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	586.90	国信证券股份有限公司

	债券(第一期)		
111	远东国际融资租赁有限公司 2024 年度第十期超短期融资券	80.33	兴业银行股份有限公司
112	云南省交通投资建设集团有限公司 2024 年度第四期中期票据	44.48	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
113	浙江杭州青山湖科技城投资集团有限公司 2020 年度第一期定向 债务融资工具	1,544.08	国信证券股份有限公司
114	浙江省德清县交通水利投资集团有限公司 2024 年度第三期定向 债务融资工具	2,912.63	中信银行股份有限公司，兴业银行股份有限公司
115	中国东方航空集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	8.90	中信银行股份有限公司
116	中国康富国际租赁股份有限公司 2024 年度第一期绿色中期票据	1,022.52	中信银行股份有限公司
117	中国盐业集团有限公司 2024 年 度第一期超短期融资券	133.94	中信银行股份有限公司
118	中国银河证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司 债券(第一期)(品种一)	8.93	国信证券股份有限公司
119	中国银河证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者非公开 发行公司债券(第三期)(品种二)	26.56	国信证券股份有限公司
120	中航国际租赁有限公司 2022 年 度第五期中期票据	2,549.30	中信银行股份有限公司
121	中信优 1	3,046.01	中信银行股份有限公司
122	中信证券股份有限公司 2021 年 面向专业投资者公开发行公司债 券(第六期)(品种一)	45.75	国信证券股份有限公司
123	重庆市涪陵国有资产投资经营集团 有限公司 2020 年度第一期定向 债务融资工具(品种一)	78.22	中信银行股份有限公司
124	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	1,741.57	中信银行股份有限公司，华夏银行股份有限公司
125	重庆渝富控股集团有限公司 2020	27.34	中信银行股份有限公司

	年度第二期中期票据		司，交通银行股份有限公司
126	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)	45.27	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)	624.84	国信证券股份有限公司
128	珠海华发综合发展有限公司 2023 年度第一期中期票据	1,575.75	华夏银行股份有限公司
129	诸暨市城乡投资集团有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第三期)(品种一)	54.89	国信证券股份有限公司
130	淄博市城市资产运营有限公司 2022 年度第四期中期票据	1,385.74	交通银行股份有限公司，国信证券股份有限公司

三、投资运作分析

3.1 基本情况。

产品名称	交银理财稳享固收精选日开 2 号（60 天持有期）理财产品				
报告期末产品份额总额	7,791,489,096.24				
报告期末产品资产净值（万元）	855,326.87				
期末杠杆水平	104.31%				
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	报告期末下属产品份额的累计单位净	今年以来年化收益率 ¹ (%)

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

			位净值	值	
交银理财 稳享固收 精选日开 2号私银 尊享（60 天持有 期）理财 产品	5811221097	585,226,418.91	1.0904	1.0904	2.4801
交银理财 稳享固收 精选日开 2号（60 天持有 期）理财 产品C	5811221104	502,978,869.49	1.0801	1.0801	2.2636
交银理财 稳享固收 精选日开 2号（60 天持有 期）理财 产品	5811221046	6,703,283,807.84	1.0997	1.0997	2.4302

以上产品资产净值、份额净值、累计净值均未扣除当期暂估的超额业绩报酬。

3.2 流动性风险分析。

本产品严格遵守监管流动性要求，并保持适度杠杆和久期操作，配置相应比例流动性较好的高等级债券，保证产品有充足的流动性应对客户赎回。

四、未来展望

债市的影响因素方面，经济基本面弱复苏，货币政策结构性宽松，财政政策加力提效，赤字率温和扩张，对未来债市持

【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）。

谨慎乐观态度。但内外部政策风险仍存，预计后期利率债呈现震荡格局，信用债存在个券机会。产品后期的配置思路为严控信用风险，灵活调整久期，主要利用流动性溢价策略、杠杆策略增厚组合收益。此外，我们建议客户在投资中，更加关注产品的长期表现，以期取得更好的投资回报。

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