

# 交银理财稳享灵动慧利 2 年封闭式 35 号理财产品定期报告（2026 年第一季度）

尊敬的客户：

我司交银理财稳享灵动慧利 2 年封闭式 35 号理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000924000794）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	2,004,187.27	0.19	7,966,047.60	0.72
同业存单	0.00	0.00	0.00	0.00
拆放同业 及债券买 入返售	0.00	0.00	0.00	0.00
债券	0.00	0.00	838,172,968.54	76.09
非标准化 债权类资 产	150,416,142.27	14.50	150,416,142.27	13.65
权益类投 资	0.00	0.00	0.00	0.00
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	104,997,958.50	9.53
私募基金	0.00	0.00	0.00	0.00

资产管理产品	885,046,128.12	85.31	0.00	0.00
委外投资——协议方式	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	1,037,466,457.66	100.00	1,101,553,116.91	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	LCTYJK 河北金租 4M260320009	9,959.49	9.04%
2	LCTYJK 邦银金租 5M260310	5,082.13	4.61%
3	中国农业银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)(债券通)	2,224.71	2.02%
4	中国建设银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)(债券通)	1,863.17	1.69%
5	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)	1,514.55	1.37%
6	中国工商银行股份有限公司 2025 年二级资本债券(第三期)(债券通)	1,077.36	0.98%
7	陕西煤业化工集团有限责任公司 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)	1,053.47	0.96%
8	2024 年中原银行股份有限公司二级资本债券(第一期)	1,030.40	0.94%
9	华西证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	1,023.54	0.93%
10	招商局蛇口工业区控股股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)	939.81	0.85%
合计		25,768.64	23.39%

### 1.3 期末非标准化债权类资产明细。

序号	融资客户名称	项目名称	剩余融资期限(月)	投资年化收益率	投后管理费/财务顾问费率	交易结构	风险状况
1	邦银金融租赁股份有限公司	LCTYJK 邦银金租 5M260310	4.00	1.91%	0.08%	同业借款	正常类

2	河北省金融租赁有限公司	LCTYJK 河北金融租 4M260320009	3.97	1.83%	0.17%	同业借款	正常类
---	-------------	--------------------------	------	-------	-------	------	-----

#### 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	投资管理费	26.38	交银理财有限责任公司
2	托管费	5.11	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	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	136.65	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	2024年广汽汇理汽车金融有限公司第二期金融债券	201.97	兴业银行股份有限公司
3	2024年中原银行股份有限公司二级资本债券(第一期)	1,030.40	兴业银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
4	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)	175.32	兴业银行股份有限公司

	通)		
5	宝山钢铁股份有限公司 2024 年度第一期中期票据(科创票据)	150.68	交通银行股份有限公司
6	北京银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券	50.54	兴业银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
7	本钢集团有限公司 2025 年度第一期科技创新债券	25.09	交通银行股份有限公司
8	常德市城市建设投资集团有限公司 2024 年度第二期定向债务融资工具	144.76	中信银行股份有限公司
9	成都交通投资集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	155.79	兴业银行股份有限公司
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	147.86	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	25.18	兴业银行股份有限公司
12	成都经开国投集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	29.02	国信证券股份有限公司
13	成都空港兴城投资集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	25.38	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
14	成都香城投资集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	144.15	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(第二期)(品种一)	153.14	国信证券股份有限公司
16	成都益航资产管理有限公司 2024 年度第一期中期票据	87.56	中信银行股份有限公司
17	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	145.48	交通银行股份有限公司
18	东莞银行股份有限公司 2024 年二级资本债券(第二期)	307.74	兴业银行股份有限公司
19	东槌 2024 年度 1 号第二期定向资产支持票据优先 A 级	149.14	国信证券股份有限公司
20	法国农业信贷银行 2024 年第二期	797.11	兴业银行股份有限公司

	人民币债券(债券通)(品种一)		司
21	抚州市市属国有资产投资控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	51.00	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
22	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(第四期)	69.29	国信证券股份有限公司
23	甘肃金融控股集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	222.00	中信银行股份有限公司
24	光明食品(集团)有限公司 2024 年度第二期中期票据	228.92	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
25	广西北部湾国际港务集团有限公司 2025 年度第八期中期票据	25.21	交通银行股份有限公司
26	广西投资集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	485.88	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
27	广西投资集团有限公司 2025 年度第七期中期票据(品种一)	29.14	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
28	国药控股(中国)融资租赁有限公司 2024 年度第七期中期票据	28.97	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
29	海发宝诚融资租赁有限公司 2024 年度第三期中期票据	50.68	兴业银行股份有限公司
30	海通恒信国际融资租赁股份有限公司 2024 年度第一期中期票据	125.35	交通银行股份有限公司
31	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	28.79	交通银行股份有限公司
32	河钢集团有限公司 2025 年度第二十三期中期票据	25.03	交通银行股份有限公司
33	河钢集团有限公司 2026 年度第五期中期票据	24.81	交通银行股份有限公司
34	恒丰银行股份有限公司 2024 年第一期二级资本债券	281.79	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
35	衡阳市城市建设投资有限公司 2025 年度第七期定向债务融资工	25.26	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限

	具		公司
36	湖州经开投资发展集团有限公司 2024年度第一期中期票据(可持续 挂钩)	205.71	兴业银行股份有限公 司
37	湖州银行股份有限公司 2024 年小 型微型企业贷款专项金融债券	254.53	兴业银行股份有限公 司
38	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)	37.46	交通银行股份有限公 司
39	华夏银行股份有限公司 2025 年无 固定期限资本债券(第一期)	62.90	国信证券股份有限公 司
40	淮安市交通控股集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	510.02	兴业银行股份有限公 司, 华夏银行股份有限 公司
41	淮安市投资控股集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	29.43	中信银行股份有限公 司
42	淮安市投资控股集团有限公司 2025 年度第七期中期票据	17.15	交通银行股份有限公 司
43	淮北市建投控股集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	26.23	兴业银行股份有限公 司
44	徽商银行股份有限公司 2024 年无 固定期限资本债券	146.40	兴业银行股份有限公 司
45	嘉兴滨海控股集团有限公司 2021 年度第二期绿色中期票据(专项乡 村振兴)	29.30	兴业银行股份有限公 司
46	建安投资控股集团有限公司 2023 年度第三期中期票据	58.66	中信银行股份有限公 司, 交通银行股份有限 公司
47	江苏高淳经济开发区开发集团有 限公司 2024 年度第一期中期票据	144.57	兴业银行股份有限公 司
48	江苏华靖资产经营有限公司 2024 年度第二期中期票据	83.14	兴业银行股份有限公 司
49	江苏江南农村商业银行股份有限 公司 2024 年二级资本债券(第二 期)	290.92	兴业银行股份有限公 司
50	江苏江南农村商业银行股份有限 公司 2024 年二级资本债券(第一 期)	762.85	兴业银行股份有限公 司

51	江苏金融租赁股份有限公司 2025 年金融债券(第一期)	573.30	兴业银行股份有限公司
52	江苏银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券(第二期)	29.23	中信银行股份有限公司
53	江苏银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券(第一期)	395.85	中信银行股份有限公司
54	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)	116.59	中信银行股份有限公司
55	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	28.81	交通银行股份有限公司
56	江西省金融控股集团有限公司 2024 年度第二期中期票据	115.26	中信银行股份有限公司
57	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	29.15	兴业银行股份有限公司
58	晋能控股煤业集团有限公司 2023 年度第十一期中期票据	800.34	中信银行股份有限公司
59	晋能控股煤业集团有限公司 2024 年度第六期中期票据	390.97	中信银行股份有限公司
60	晋能控股煤业集团有限公司 2025 年度第七期中期票据	58.38	交通银行股份有限公司
61	晋能控股装备制造集团有限公司 2023 年度第八期中期票据	327.18	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
62	晋能控股装备制造集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	17.06	交通银行股份有限公司
63	鲁西化工集团股份有限公司 2025 年度第一期科技创新债券(可持续挂钩)	28.90	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
64	宁波银行股份有限公司 2025 年第一期无固定期限资本债券	17.17	兴业银行股份有限公司
65	平安国际融资租赁有限公司 2024 年度第五期中期票据	29.33	兴业银行股份有限公司
66	平安银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券	58.48	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
67	平安银行股份有限公司 2025 年无	37.72	兴业银行股份有限公司

	固定期限资本债券(第二期)(债券通)		司, 国信证券股份有限公司
68	平安银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)(债券通)	172.85	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
69	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)	25.06	交通银行股份有限公司
70	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)	85.23	国信证券股份有限公司
71	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)	25.36	国信证券股份有限公司
72	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	29.19	交通银行股份有限公司
73	青岛西海岸新区融合控股集团有限公司 2022 年度第一期中期票据(项目收益)	145.68	交通银行股份有限公司
74	厦门国贸控股集团有限公司 2024 年度第六期中期票据(混合型科创票据)	29.45	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
75	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)	24.81	交通银行股份有限公司
76	厦门国有资本运营有限责任公司 2024 年度第一期中期票据	86.77	兴业银行股份有限公司
77	厦门象屿集团有限公司 2026 年度第二期中期票据(品种二)	24.83	中信银行股份有限公司
78	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(第三期)	156.08	国信证券股份有限公司
79	山东黄金集团有限公司 2024 年度第二期中期票据(科创票据)	692.98	国信证券股份有限公司
80	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)	271.82	国信证券股份有限公司

81	陕西电子信息集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	173.58	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
82	陕西金融控股集团有限公司 2024 年度第二期中期票据	146.00	兴业银行股份有限公司
83	陕西煤业化工集团有限责任公司 2025 年度第四期中期票据	28.79	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
84	上海国际集团有限公司 2021 年度第一期中期票据	127.79	交通银行股份有限公司
85	上海浦东发展银行股份有限公司 2025 年第二期无固定期限资本债券	86.53	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
86	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	173.98	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
87	上海上实(集团)有限公司 2024 年度第一期中期票据	375.05	兴业银行股份有限公司
88	上海新微科技集团有限公司 2025 年度第一期科技创新债券	25.42	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
89	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)	99.31	国信证券股份有限公司
90	绍兴市上虞杭州湾经开区控股集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)(品种一)	221.09	国信证券股份有限公司
91	深圳担保集团有限公司 2025 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	28.99	国信证券股份有限公司
92	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	16.89	中信银行股份有限公司
93	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(第三期)(品种二)	177.94	国信证券股份有限公司
94	深圳资产管理有限公司 2024 年面	50.38	国信证券股份有限公司

	向专业投资者公开发行人公司债券 (第三期)(品种一)		司
95	深圳资产管理有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行人公司债券 (第一期)(品种一)	402.45	国信证券股份有限公司
96	沈阳地铁集团有限公司 2024 年度 第二期中期票据	404.85	中信银行股份有限公司
97	书赞桉诺国际金融有限公司 2025 年第一期中期票据(债券通)(品种 一)	25.09	交通银行股份有限公司, 汇丰银行(中国)有限公司
98	蜀道投资集团有限责任公司 2025 年度第三期超短期融资券	24.92	交通银行股份有限公司
99	蜀道投资集团有限责任公司 2025 年度第三期短期融资券	24.91	兴业银行股份有限公司
100	苏州银行股份有限公司 2025 年二 级资本债券(第一期)	25.35	兴业银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
101	台州银行股份有限公司 2024 年无 固定期限资本债券(第一期)	293.01	兴业银行股份有限公司
102	泰安市泰山财金投资集团有限公 司 2024 年度第二期中期票据(品 种一)	231.05	中信银行股份有限公司
103	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 种一)	34.37	华夏银行股份有限公司
104	泰州市交通产业集团有限公司 2023 年度第二期中期票据	146.08	交通银行股份有限公司
105	天津城市基础设施建设投资集团 有限公司 2024 年度第十期中期票 据	351.72	中信银行股份有限公司
106	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 者非公开发行人公司债券(第三期)	25.50	国信证券股份有限公司
107	武汉金融控股(集团)有限公司 2023 年度第二期中期票据	117.45	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
108	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)	24.95	交通银行股份有限公司, 兴业股份有限

			公司
109	新希望六和股份有限公司 2026 年度第一期绿色科技创新债券(乡村振兴)	24.90	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
110	信安国际商业保理有限公司 2025 年度第一期定向资产支持票据优先级	57.97	兴业银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
111	兴业消费金融股份公司 2024 年第四期金融债券	292.08	兴业银行股份有限公司
112	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	6.21	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
113	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	29.18	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
114	扬州新材料投资集团有限公司 2023 年度第一期中期票据	117.22	中信银行股份有限公司
115	阳光人寿保险股份有限公司 2026 年资本补充债券	24.61	兴业银行股份有限公司
116	云南省投资控股集团有限公司 2025 年度第十三期中期票据	25.17	交通银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
117	长城证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种二)	89.12	国信证券股份有限公司
118	长城证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种二)	255.22	国信证券股份有限公司
119	长沙银行股份有限公司 2024 年无固定期限资本债券	58.36	兴业银行股份有限公司
120	长沙银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券	25.12	兴业银行股份有限公司
121	浙江荣盛控股集团有限公司 2025 年度第三期短期融资券	28.84	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
122	浙江省国际贸易集团有限公司 2025 年度第一期中期票据	51.07	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司

			公司
123	浙江省兴合集团有限责任公司 2024年度第二期中期票据	148.09	兴业银行股份有限公司
124	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	25.39	交通银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
125	中国城乡控股集团有限公司 2024 年度第一期中期票据	291.26	中信银行股份有限公司, 兴业银行股份有限公司
126	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)	68.23	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
127	中国工商银行股份有限公司 2024 年二级资本债券(第一期)(债券 通)(品种一)	29.30	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
128	中国工商银行股份有限公司 2025 年二级资本债券(第二期)(债券通)	649.84	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
129	中国工商银行股份有限公司 2025 年二级资本债券(第三期)(债券通)	1,077.36	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
130	中国工商银行股份有限公司 2025 年二级资本债券(第一期)(债券通)	749.27	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
131	中国工商银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第二 期)(债券通)	100.59	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
132	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)	1,514.55	交通银行股份有限公司, 国信证券股份有限公司
133	中国供销集团有限公司 2024年度 第一期中期票据	58.42	中信银行股份有限公司
134	中国光大银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)	87.33	交通银行股份有限公司
135	中国广核电力股份有限公司 2025 年度第一期中期票据	28.71	交通银行股份有限公司
136	中国海螺创业控股有限公司 2023 年度第二期绿色中期票据(债券通)	29.31	兴业银行股份有限公司

137	中国建设银行股份有限公司 2024 年二级资本债券(第二期)(品种一)	25.48	交通银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
138	中国建设银行股份有限公司 2024 年二级资本债券(第三期)(债券通)	233.25	交通银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
139	中国建设银行股份有限公司 2025 年二级资本债券(第二期)(债券通)(品种一)	722.32	交通银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
140	中国建设银行股份有限公司 2025 年二级资本债券(第一期)(债券通)	232.48	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
141	中国建设银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)(债券通)	1,863.17	交通银行股份有限公司, 华夏银行股份有限公司
142	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)	50.72	兴业银行股份有限公司
143	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)	86.07	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
144	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)	58.23	兴业银行股份有限公司
145	中国燃气控股有限公司 2025 年度第五期中期票据	28.92	中信银行股份有限公司, 交通银行股份有限公司
146	中国太平洋人寿保险股份有限公司 2023 年无固定期限资本债券(第一期)	156.62	交通银行股份有限公司
147	中国邮政储蓄银行股份有限公司 2025 年无固定期限资本债券(第一期)(债券通)	143.17	交通银行股份有限公司
148	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	145.23	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
149	中铁一局集团有限公司 2024 年度	51.08	交通银行股份有限公司

	第一期资产支持票据(科创票据)优先级		司
150	中铁一局集团有限公司 2025 年度第一期资产支持票据优先级	50.39	交通银行股份有限公司
151	中银消费金融有限公司 2024 年金融债券(第四期)	290.44	兴业银行股份有限公司
152	中银消费金融有限公司 2024 年金融债券(第五期)	377.99	兴业银行股份有限公司
153	中原银行股份有限公司 2024 年小型微型企业贷款专项金融债券(第一期)	171.20	兴业银行股份有限公司
154	重庆市合川城市建设投资(集团)有限公司 2023 年度第四期中期票据(品种二)	59.18	兴业银行股份有限公司
155	重庆市江津区华信资产经营(集团)有限公司 2023 年度第二期定向债务融资工具	204.74	中信银行股份有限公司
156	重庆医药(集团)股份有限公司 2024 年度第二期中期票据	57.78	中信银行股份有限公司
157	淄博市城市资产运营有限公司 2021 年非公开发行公司债券(第二期)(品种二)	77.07	国信证券股份有限公司
158	淄博市城市资产运营有限公司 2021 年非公开发行公司债券(第一期)(品种二)	76.90	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 996,274,730.00 份，产品单位净值为 1.0413，产品单位累计净值为 1.0413，产品资产净值为 1,037,427,572.46 元，期末杠杆水平为 106.18%。今年以来年化收益率<sup>1</sup>为 1.4669%。

<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

### 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，保证产品在到期有充足的流动性应对客户赎回。

## 四、未来展望

本产品定位于中期限类产品，主要投资于债券及其他固收类资产，组合底层配置了一定比例的低波动性资产以期提升组合的夏普率与风险收益比，根据宏观环境战术调整久期。26年以来，经济延续缓和复苏，政策引导上比较审慎。与此同时，基本面复苏斜率偏低、通胀维持低位，但是基本面韧性较强，债券市场后续或以震荡下行行情为主。基于此，后期的配置思路为严控信用风险，注重票息保护，灵活调整久期和杠杆，同时利用流动性溢价策略、骑乘策略与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体验。

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