

## 招商银行日日盈理财计划

### 2020 年第 1 季度报告

（产品代码：7002 8166 8168 8169 9439 9449 9469）

理财产品管理人：招商银行股份有限公司

理财产品托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 日

## 目 录

§ 1	重要提示.....	3
1.1	重要提示.....	3
§ 2	理财产品简介.....	3
2.1	理财产品基本情况.....	3
§ 3	理财产品净值表现.....	4
3.1	截至报告期末产品资产净值及份额净值.....	4
§ 4	管理人报告.....	4
4.1	管理人对报告期内理财产品的投资策略说明.....	4
4.2	理财产品报告期内参与关联方交易情况.....	4
§ 5	托管人报告.....	7
5.1	托管人报告.....	7
§ 6	投资组合报告.....	7
6.1	期末理财产品资产组合情况.....	7
6.2	期末投资组合前十名资产.....	8
6.3	期末非标准化债权类资产信息.....	8
6.4	期末信贷资产收益权资产信息.....	8

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

- 1、本报告适用于招商银行日日盈理财计划。产品管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
  - 2、理财产品管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用理财产品资产，但不保证理财产品本金和收益。
  - 3、理财产品的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本理财产品的产品说明书。
  - 4、本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。
- 注：除非本报告另有说明，本报告内的“元”均指“人民币元”

## § 2 理财产品简介

### 2.1 理财产品基本情况

理财产品代码	8166、8168，本销售渠道面向个人投资者发售，投资者可通过招商银行营业网点、招商银行财富账户、个人银行专业版、大众版或者招商银行其他认可的方式办理认购/申购；8169，本销售渠道面向个人投资者发售，投资者须通过手机银行 Android 版、iPhone 版、iPad 版、HTML 网页版及后续版本或者招商银行其他认可的方式办理认购/申购。9439、9449、9469，本销售渠道面向我行钻石卡、私人银行卡客户发售，投资者可通过招商银行营业网点、招商银行财富账户、个人银行专业版、大众版或者招商银行其他认可的方式办理认购/申购。7002，本销售渠道面向企业投资者发售，投资者可通过招商银行营业网点、招商银行网上银行或者招商银行其他认可的方式办理认购/申购。
理财产品名称	招商银行日日盈理财计划
理财产品登记编码	C1030809000012
产品投资类型	固定收益类
产品募集方式	公募
理财产品运作方式	开放式
业绩比较基准	中国人民银行公布的 7 天通知存款利率
产品风险评级	R2(平衡型)
杠杆水平上限	140%
报告期末理财产品份额总额	174,350,601,582.00

理财产品成立日	2009年3月27日
理财产品计划到期日	2050年9月1日（如遇非交易日期顺延至下一交易日，或在理财计划存续期内招商银行根据本产品说明书约定事由宣布提前或延期终止本理财计划之日。）

### § 3 理财产品净值表现

#### 3.1 截至报告期末产品资产净值及份额净值

截至本报告期末，产品的资产净值为 174,350,601,582.00 元。

### § 4 管理人报告

#### 4.1 管理人对报告期内理财产品的投资策略说明

##### 4.1.1 报告期内理财产品投资策略和运作分析

2020年1月末至今，受境内外疫情逐渐发酵，及各国货币政策逐渐发力影响，债券收益率有较大幅度下行；期间2月中旬收益率有所震荡，3月上旬受美元流动性危机影响债市出现小幅回调，但此两段插曲不改变收益率下行的大趋势。流动性方面，除1月中旬资金价格偏高以外，货币政策在一季度的基调还是以有节制的宽松为主，主要目标在于保障就业和降低实体经济融资成本，但不搞大水漫灌式刺激。

本产品为高流动性现金管理类产品，报告期内运作平稳，产品规模稳步增长，资产配置上以高等级债券、同业存款、存单等低风险资产为主，久期，杠杆水平适中。

##### 4.1.2 管理人对未来的简要展望

长期来看，全球经济面临共振下行压力，疫情的持续时间及烈度将成为影响市场走势的关键变量；中短期来看，国内货币政策和财政政策均逐渐发力，一多一空两种力量的对比亦将为市场带来更多不确定性。

#### 4.2 理财产品报告期内参与关联方交易情况

##### 4.2.1 理财产品在报告期内投资关联方发行的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券简称	报告期内买入证券	
			数量（单位：张）	总金额（单位：元）
中交第三航务工程局有限公司	042000102	20 中交三航 CP001	700,000	70,000,000.00

中远海运控股股份有限公司	012000612	20 中远海控(疫情防控债)SCP001	500,000	49,912,976.78
中交一公局集团有限公司	012000552	20 中交一公 SCP003	1,000,000	99,977,022.95
中交第一航务工程局有限公司	012000322	20 中交一航 SCP002	400,000	40,000,000.00
中交第一航务工程局有限公司	012000133	20 中交一航 SCP001	1,000,000	100,311,903.28
中远海运发展股份有限公司	012000330	20 中远海发 SCP001	2,000,000	199,307,260.11
国泰君安证券股份有限公司	072000012	20 国泰君安 CP001	500,000	50,224,927.32
招商证券股份有限公司	143626.SH	18 招商 G2	300,000	31,081,974.92
招商证券股份有限公司	166206.SH	20 招商 F1	4,300,000	430,000,000.00
国泰君安证券股份有限公司	143607.SH	18 国君 G2	400,000	42,302,305.31
招商证券股份有限公司	143626.SH	18 招商 G2	200,000	20,715,497.43
招商证券股份有限公司	143626.SH	18 招商 G2	100,000	10,357,748.72
国泰君安证券股份有限公司	143607.SH	18 国君 G2	20,000	2,116,381.85
国泰君安证券股份有限公司	143607.SH	18 国君 G2	200,000	21,163,818.42
中信建投证券股份有限公司	072000022	20 中信建投 CP002	3,500,000	350,000,000.00
国泰君安证券股份有限公司	143229.SH	17 国君 G1	100,000	10,332,225.40
重庆银行股份有限公司	111985354	19 重庆银行 CD092	1,000,000	98,639,308.74

招商证券股份有限公司	143626.SH	18 招商 G2	300,000	31,072,259.84
------------	-----------	----------	---------	---------------

#### 4.2.2 理财产品在报告期内投资关联方承销的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券简称	报告期内买入证券	
			数量(单位:张)	总金额(单位:元)
招商银行股份有限公司	082000071	20 和信立诚 ABN001 优先	180,000	18,000,000.00
招商银行股份有限公司	082000113	20 惠源 ABN003 优先 A	1,970,000	197,000,000.00
中信建投证券股份有限公司	2089026	20 浦鑫安居 1A1	800,000	80,000,000.00
中信建投证券股份有限公司	138404.SZ	中信建投-北京一方天著 8 期供应链金融资产支持专项计划	100,000	10,000,000.00
招商证券资产管理有限公司	165888.SH	20 京诚 2A	550,000	55,000,000.00
招商证券股份有限公司	166206.SH	20 招商 F1	4,300,000	430,000,000.00
招商银行股份有限公司	072000060	20 财通证券 CP003	9,000,000	900,000,000.00
招商银行股份有限公司	012000030	20 鲁国资 SCP001	500,000	50,000,000.00
招商银行股份有限公司	012000822	20 东北电力 SCP002	400,000	40,000,000.00
招商银行股份有限公司	072000023	20 国信证券 CP001	4,000,000	400,000,000.00
中信建投证券股份有限公司	162908.SH	20 银河 C1	200,000	20,000,000.00
中信建投证券股份有限公司	166228.SH	20 银河 F3	3,200,000	320,000,000.00
中信建投证券股份有限公司	072000022	20 中信建投 CP002	3,500,000	350,000,000.00

#### 4.2.3 理财产品在报告期内其他重大关联交易

资产代码	资产名称	交易类型	关联方角色	关联方名称	总金额(单位:元)
-	-	-	-	-	-

## § 5 托管人报告

### 5.1 托管人报告

托管人声明,在本报告期内,理财产品托管人——招商银行股份有限公司严格遵守有关法律法规、托管协议关于托管人职责的约定,尽职尽责地履行了托管职责。

在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下,在我行能够知悉和掌握的情况范围内,我行对理财产品管理人报告中的财务数据进行了复核,未发现存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的情形。

## § 6 投资组合报告

### 6.1 期末理财产品资产组合情况

序号	项目	直接投资		间接投资	
		资产余额 (单位:元)	占产品总资产的比例 (%)	资产余额 (单位:元)	占产品总资产的比例 (%)
1	固定收益类	182,724,903,664.36	96.76	6,114,142,844.99	3.24
	其中:债券	136,734,083,904.65	72.41	-	-
	一般债权	-	-	-	-
	资产支持证券	14,918,299,486.44	7.90	-	-
	现金及货币工具	31,072,520,273.27	16.45	6,114,142,844.99	3.24
	含权债权	-	-	-	-
2	权益类	-	-	-	-
3	商品类	-	-	-	-
4	金融衍生类	-	-	-	-
5	混合类	-	-	-	-
	合计	182,724,903,664.36	96.76	6,114,142,844.99	3.24

注:占产品总资产的比例=资产余额/产品总资产,占比结果保留两位小数(因第二位小数四舍五入,可能存在尾差)。

## 6.2 期末投资组合前十名资产

序号	资产名称	期末资产余额 (单位：元)	占产品净资产 的比例 (%)
1	*人保资产安心盛世79号资产管理产品-招商银行产品	4,952,906,849.59	2.84
2	17农发04	1,830,976,507.50	1.05
3	18农发08	1,667,356,422.07	0.96
4	中国信达资产管理-同业借款	1,559,062,055.56	0.89
5	11国开07	1,402,466,985.66	0.80
6	16国开07	1,375,537,479.63	0.79
7	17国开01	1,202,053,845.10	0.69
8	18国开04	1,157,438,486.03	0.66
9	19国开11	1,144,406,109.72	0.66
10	15国开09	1,094,089,868.50	0.63

注：占产品净资产的比例=资产余额/产品净资产，占比结果保留两位小数（因第二位小数四舍五入，可能存在尾差）。

## 6.3 期末非标准化债权类资产信息

项目名称	融资客户名称	项目剩余 融资期限 (单位：天)	报告期内到 期收益率预 估 (%)	交易结构
-	-	-	-	-

注：报告期内到期收益率预估是指报告期内管理人根据底层资产在报告期内的资产情况，收益分配情况及费用进行预估的收益率。最终以实际到期收到资金为准。

## 6.4 期末信贷资产收益权资产信息

资产名称	原始权益人名称	项目剩余融资期限 (单位：天)
-	-	-



招商银行股份有限公司  
2020年4月22日