

华夏理财固定收益纯债型一年定开理财产品 11 号

2023 年第 1 季度报告

重要信息提示：

- 1、理财非存款，产品有风险，投资须谨慎。理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益。
- 2、华夏理财有限责任公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏理财有限责任公司

产品托管人：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 3 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益纯债型一年定开理财产品 11 号
理财产品代码	22113011
A 份额销售代码	22113011A
E 份额销售代码	22113011E
V 份额销售代码	22113011V
产品登记编码	Z7003922000097
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式
产品投资性质	固定收益类
投资及收益币种	人民币
产品风险评级	PR2 级（中低风险）
杠杆水平	126.63%
产品起始日期	2022-09-23
产品终止日期	无特定存续期限

第二章 净值、存续规模及收益表现

A 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	0.9996	113,514,394.00	0.9996	113,465,706.26	2.04%
2022-12-31	0.9796	113,514,394.00	0.9796	111,193,808.22	

E 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0006	39,005,925.00	1.0006	39,029,593.73	2.09%
2022-12-31	0.9801	39,005,925.00	0.9801	38,229,259.70	

V 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0001	120,000,000.00	1.0001	120,010,657.49	2.07%
2022-12-31	0.9798	120,000,000.00	0.9798	117,578,722.29	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*100%

第三章 资产持仓

3.1 期末产品资产持仓情况

序号	资产类别	穿透前占总资产比例	穿透后占总资产比例
1	现金及银行存款	0.01%	0.51%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.94%
4	债券	0.00%	98.55%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.00%
7	金融衍生品	0.00%	0.00%
8	代客境外理财投资 QDII	0.00%	0.00%
9	商品类资产	0.00%	0.00%
10	另类资产	0.00%	0.00%
11	公募基金	0.00%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.99%	0.00%
14	委外投资——协议方式	0.00%	0.00%

注：由于计算中四舍五入的原因，占总资产的比例可能存在尾差；“权益类投资”类别中包含永续债和优先股。

3.2 期末产品持有的前十项资产

序号	资产名称	资产类别	持有金额 (元)	占总资产 的比例
1	湘江 22Y	债券	5,619,435.63	1.63%
2	22 安控 02	债券	5,608,474.13	1.63%
3	22 秀宏 02	债券	5,534,052.49	1.60%
4	22 瓯江 01	债券	5,471,379.65	1.59%
5	19 株国 03	债券	5,170,637.04	1.50%
6	21 良渚 01	债券	5,082,755.01	1.47%
7	22 河钢 K1	债券	4,938,216.81	1.43%
8	19 昆交 05	债券	4,201,828.68	1.22%
9	22 南部新城 MTN002	债券	4,037,697.74	1.17%
10	22GT2A2	债券	3,990,191.91	1.16%

3.3 期末产品持有的非标准化债权类资产

序号	融资客户	项目名称	交易结构	收益率 (%)	剩余期限 (天)	风险状况
-	-	-	-	-	-	-

3.4 报告期内关联交易情况

3.4.1 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	证券名称	投资规模（元）
-	-	-	-

3.4.2 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	证券名称	投资规模（元）
-	-	-	-

3.4.3 报告期内其他关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	投资规模（元）
中诚信托有 限责任公司	ZC1A2W OTC	中诚信托汇鑫 14 号 集合资金信托计划	买入	40,000,000.00

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份份额分红	每万份现金分红
-	-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前组合流动性风险可控。

5.2 投资组合投资风险分析

5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优。根据公司理财资产风险分类的要求,持仓中 20 时代 10 (代码 167340.SH) 的资产风险分类为关注类,该券在产品持仓中占比不高于 0.06%,对产品净值影响较小。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10250000003306847

第七章 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。