

# 华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 1 号

## 2024 年第 1 季度报告

### 重要信息提示：

- 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。
- 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 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日日开理财产品 1 号
理财产品代码	21112001
A 份额销售代码	21112001A
D 份额销售代码	21112001D
G 份额销售代码	21112001G
H 份额销售代码	21112001H
K 份额销售代码	21112001K
产品登记编码	Z7003921000744
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	PR1 级（低风险）
杠杆水平	101.90%
产品起始日期	2022-07-21
产品终止日期	无特定存续期限

注：由于子份额可能存在募集金额或存续金额为 0，导致无持有人的情形，本报告仅列示报告期末存续金额不为 0 的相关子份额信息。

## 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0434	3,918,396,993.52	1.0434	4,088,267,983.27	0.65%
2023-12-31	1.0367	5,512,376,154.54	1.0367	5,714,929,798.36	

### D 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0434	1,040,046,668.24	1.0434	1,085,178,365.57	0.64%
2023-12-31	1.0368	928,660,511.43	1.0368	962,863,255.17	

### G 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0415	253,670,385.22	1.0415	264,198,225.63	0.63%
2023-12-31	1.0350	380,921,341.42	1.0350	394,257,157.28	

### H 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0407	1,254,139,443.63	1.0407	1,305,220,906.52	0.63%
2023-12-31	1.0342	5,977,890,239.16	1.0342	6,182,078,885.90	

### K 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0188	421,777,694.24	1.0188	429,720,060.02	0.64%
2023-12-31	1.0123	272,459,681.86	1.0123	275,811,089.73	

注：期间净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值\*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	0.09%	93.03%
2	同业存单	0.00%	0.01%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	6.91%
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%	0.06%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.91%	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	中行南京河西支行 20231107-35	现金及银行存款	735,336,046.85	10.06%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	435,230,026.17	5.95%
3	中行徐州分行 20231107-15	现金及银行存款	315,181,396.37	4.31%
4	农行东莞厚街支行 20231114-20	现金及银行存款	214,358,162.14	2.93%
5	农行东莞塘厦支行 20231114-20	现金及银行存款	214,358,162.14	2.93%
6	农行珠海分行 20230927-10	现金及银行存款	210,749,840.28	2.88%
7	建行淮安楚州支行 20230927-10	现金及银行存款	210,749,840.28	2.88%
8	建行淮安洪泽支行 20230927-10	现金及银行存款	210,749,840.28	2.88%
9	农行东莞凤岗支行 20231110-15	现金及银行存款	160,761,104.09	2.20%
10	农行南海盐步支行 20231122-15	现金及银行存款	160,673,342.50	2.20%

### 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）
中国建设银行股份有限 公司	232480006	24 建行二级资本债 01A	8,776,345.44

#### 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）
招商证券股份有限公司	143948	国贸 1 优 2	98,648.97

#### 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）
英大保险资 产管理有限 公司	601082 OTC	英大资产-聚鑫 11 号 资产管理产品	买入	24,000,000.00
英大保险资 产管理有限 公司	YD-HLYJ OTC	英大资产-活利壹玖 资产管理产品	买入	928,000,000.00

## 第四章 收益分配情况

除权日期	每万份理财份额分红数（元）
-	-

## 第五章 风险分析

### 5.1 投资组合流动性风险分析

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控。

### 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

本产品持仓信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生，价格波动可控。

#### 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	10257000000892542

## 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。