

华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 5 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：中信银行股份有限公司

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 5 号
理财产品代码	23112005
A 份额销售代码	23112005A
M 份额销售代码	23112005M
Y 份额销售代码	23112005Y
Z 份额销售代码	23112005Z
产品登记编码	Z7003923000417
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	107.82%
产品起始日期	2023-09-27
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	1.0152	7,516,594,850.22	1.0152	7,630,554,773.60	0.70%
2023-12-31	1.0081	6,652,734,201.39	1.0081	6,706,768,214.21	

M 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	1.0115	1,657,413,918.00	1.0115	1,676,495,380.28	0.70%
2023-12-31	1.0045	3,041,943,793.02	1.0045	3,055,657,730.73	

Y 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	1.0120	3,454,892,434.56	1.0120	3,496,383,910.88	0.71%
2023-12-31	1.0049	3,984,950,419.14	1.0049	4,004,304,451.02	

Z 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	1.0063	11,013.00	1.0063	11,082.76	0.63%
2024-01-05	1.0000	-	1.0000	-	

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	0.00%	73.48%
2	同业存单	0.00%	0.46%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	22.51%
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%	3.54%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	100.00%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	911,216,166.19	6.60%
2	中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026-40	现金及银行存款	588,723,387.75	4.26%
3	中行扬州分行 20231031-20	现金及银行存款	496,316,102.80	3.60%
4	中行常州武进支行 20231107-15	现金及银行存款	372,145,340.81	2.70%
5	中行南京河西支行 20231107-35	现金及银行存款	256,280,012.85	1.86%
6	建行南通如皋支行 20230921-10	现金及银行存款	248,961,736.88	1.80%
7	建行南通如东支行 20230921-10	现金及银行存款	248,961,736.88	1.80%
8	建行南通海安支行 20230921-10	现金及银行存款	248,961,736.88	1.80%
9	建行丹阳支行 20230920-10	现金及银行存款	248,956,111.46	1.80%
10	建行镇江分行 20230927-10	现金及银行存款	248,816,404.09	1.80%

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）
平安银行股份有限公司	112411052	24 平安银行 CD052	35,581,864.52
兴业国信资产管理有限 公司	115293	23 兴信 02	1,291,809.35

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	ZC1BGI OTC	中诚信托-汇鑫 19 号 集合资金信托计划	买入	428,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2023 11010022374 OTC	中诚信托-汇鑫 22 号 集合资金信托计划	买入	19,500,000.00

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置现金类、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,债券价格波动处于市场合理区间范围。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截至本报告日,无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	8110501013402345004

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。