

华夏理财固定收益纯债最短持有7天理财产品D款

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最短持有 7 天理财产品 D 款
理财产品代码	23115013
A 份额销售代码	23115013A
E 份额销售代码	23115013E
F 份额销售代码	23115013F
M 份额销售代码	23115013M
V 份额销售代码	23115013V
W 份额销售代码	23115013W
Z 份额销售代码	23115013Z
产品登记编码	Z7003923000419
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	102.26%
产品起始日期	2023-09-26
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	1.0120	4,631,248,604.31	1.0120	4,686,702,884.63	0.76%
2023-12-31	1.0044	2,208,534,706.70	1.0044	2,218,305,925.47	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0072	318,892.53	1.0072	321,200.92	0.71%
2023-12-31	1.0001	189,205.18	1.0001	189,217.88	

F 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	1.0116	725,358,043.68	1.0116	733,741,264.03	0.74%
2023-12-31	1.0042	73,909,106.86	1.0042	74,222,985.13	

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	1.0157	551,963,299.54	1.0157	560,642,420.28	0.72%
2023-12-31	1.0084	602,185,467.55	1.0084	607,232,834.01	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0114	61,162,546.02	1.0114	61,862,604.15	0.72%
2023-12-31	1.0042	6,372,506.31	1.0042	6,399,355.82	

W 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	1.0124	279,881,228.18	1.0124	283,359,893.93	0.67%
2023-12-31	1.0057	402,473,159.34	1.0057	404,764,473.25	

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	1.0066	32,910,819.87	1.0066	33,128,301.86	0.66%
2024-01-08	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	0.30%	46.80%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.42%
4	债券	0.00%	48.49%
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%	4.29%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.70%	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	589,434,701.09	9.06%
2	中行雄县支行 20240208-30	现金及银行存款	130,158,183.78	2.00%
3	建行溧阳嘉丰支行 20231215-35	现金及银行存款	119,064,648.85	1.83%
4	金隅 01 优	债券	111,472,663.54	1.71%
5	工鑫 23A2	债券	95,311,195.36	1.47%
6	23 皋通 01	债券	94,942,014.16	1.46%
7	22 能投 02	债券	87,956,541.00	1.35%
8	20 宁城 03	债券	86,928,848.50	1.34%
9	19 滨州 01	债券	86,117,196.66	1.32%
10	农行天津滨海分行 20230906/12	现金及银行存款	80,597,441.30	1.24%

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）
首创证券股份有限公司	143976	中技 1 优 1	405,079.82

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）
-	-	-	-	-

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系最短持有期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

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

截止本报告日，产品投资的债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益类资产持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	1025700000946522

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。