

华夏理财固定收益纯债最短持有 28 天理财 产品 A 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 28 天理财产品 A 款
理财产品代码	23115018
A 份额销售代码	23115018A
F 份额销售代码	23115018F
J 份额销售代码	23115018J
M 份额销售代码	23115018M
W 份额销售代码	23115018W
产品登记编码	Z7003923000433
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	111.24%
产品起始日期	2023-10-13
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	1.0144	5,227,855,289.71	1.0144	5,303,242,458.39	0.76%
2023-12-31	1.0067	5,039,187,263.29	1.0067	5,072,996,646.02	

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	1.0107	754,298,325.54	1.0107	762,396,670.59	0.74%
2023-12-31	1.0033	468,957,525.42	1.0033	470,487,285.07	

J 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	1.0107	2,598,881,741.06	1.0107	2,626,757,010.38	0.75%
2023-12-31	1.0032	2,598,881,741.06	1.0032	2,607,105,636.00	

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	1.0138	230,114,601.29	1.0138	233,294,904.28	0.76%
2023-12-31	1.0062	212,101,479.41	1.0062	213,421,672.57	

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	1.0122	12,908,943.34	1.0122	13,066,192.03	0.71%
2023-12-31	1.0051	254,802.03	1.0051	256,090.23	

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	0.02%	51.15%
2	同业存单	0.00%	0.29%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	44.49%
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%	4.08%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.98%	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	580,487,701.84	5.84%
2	建行溧阳嘉丰支行 20231215-35	现金及银行存款	347,375,871.75	3.49%
3	建行南京江宁支行 20231205-20	现金及银行存款	324,773,819.87	3.27%
4	建行秦淮支行 20231205-20	现金及银行存款	324,773,819.87	3.27%
5	建行徐州分行 20231207-20	现金及银行存款	324,712,501.45	3.27%
6	建行沭阳支行 20231208-15.2	现金及银行存款	246,839,452.65	2.48%
7	23 济轨 Y3	债券	184,837,386.49	1.86%
8	建行宝应华夏支行 20231130-10	现金及银行存款	162,404,549.78	1.63%
9	建行涟水支行 20231208-10	现金及银行存款	162,341,760.89	1.63%
10	建行扬州新区支行 20231213-15	现金及银行存款	148,903,561.30	1.50%

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）
招商证券股份有限公司	143948	国贸1优2	13,013.70

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	2,135,000,000.00

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	10257000000947752

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。