

华夏理财固定收益增强最短持有 100 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	华夏理财固定收益增强最短持有 100 天理财产品 A 款
理财产品代码	22135008
A 份额销售代码	22135008A
F 份额销售代码	22135008F
S 份额销售代码	22135008S
W 份额销售代码	22135008W
产品登记编码	Z7003922000121
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	102.78%
产品起始日期	2022-11-10
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	1.0451	5,565,148,456.37	1.0451	5,816,035,333.89	0.74%
2023-12-31	1.0374	6,942,584,721.11	1.0374	7,202,001,111.27	

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	1.0452	504,768,619.92	1.0452	527,565,869.64	0.75%
2023-12-31	1.0374	1,195,177,828.92	1.0374	1,239,850,710.40	

S 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	1.0165	94,843,814.95	1.0165	96,411,863.68	0.78%
2023-12-31	1.0086	19,951,719.54	1.0086	20,124,050.00	

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	1.0137	18,015,074.96	1.0137	18,261,270.33	0.75%
2023-12-31	1.0062	16,356,125.70	1.0062	16,457,201.62	

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	0.83%	57.20%
2	同业存单	0.00%	0.67%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.15%
4	债券	8.04%	33.17%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	6.05%
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%	2.76%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	91.13%	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	466,355,387.84	7.03%
2	中行雄县支行 20240208-30	现金及银行存款	197,764,805.40	2.98%
3	中行南京河西支行 20231107-35	现金及银行存款	191,604,916.14	2.89%
4	民生优 1	权益类投资	171,668,990.49	2.59%
5	农行天津滨海分行 20230906/12	现金及银行存款	166,535,638.07	2.51%
6	建行张家界桑植支行 20230824-15	现金及银行存款	141,017,654.04	2.12%
7	建行邵阳城南支行 20230824-15	现金及银行存款	141,017,654.04	2.12%
8	19 信投 03	债券	120,413,293.78	1.81%
9	19 新锦 01	债券	113,139,796.30	1.70%
10	农行北京门头沟支行 20230908/8	现金及银行存款	111,006,741.11	1.67%

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	34,143.18
兴业国信资产管理有限 公司	115293	23 兴信 02	4,567.33

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	35,261.57

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

流动性风险管理方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金、正逆回购及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是产品持有有一定比例的高流动性资产，赎回期内主要通过正回购操作或卖出部分资产变现，满足产品的流动性需求。

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，本产品投资的债券价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，产品投资的权益资产价格波动对组合净值的影响保持在可控范围内。

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	10250000003316573

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。