

华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 40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封闭式理财产品 40 号
理财产品代码	23111040
产品登记编码	Z7003923000050
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式
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	157.04%
产品起始日期	2023-09-22
产品终止日期	2026-09-22

第二章 净值、存续规模及收益表现

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	1.0155	500,000,000.00	1.0155	507,762,810.29	0.87%
2023-12-31	1.0067	500,000,000.00	1.0067	503,368,091.22	

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%	0.83%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	99.17%
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%	0.00%
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	23 豫保 01	债券	49,057,428.97	6.15%
2	23 象屿 G2	债券	46,946,732.48	5.89%
3	23 国惠 01	债券	46,135,779.27	5.79%
4	22 广电山东 MTN001	债券	45,759,381.83	5.74%
5	23 领航 32	债券	45,347,852.10	5.69%
6	23 华港 02	债券	40,974,852.49	5.14%
7	23 鄂科 02	债券	40,898,854.45	5.13%
8	23 山东土地 MTN003	债券	40,706,968.55	5.10%
9	23 中原豫资 MTN002	债券	40,697,565.93	5.10%
10	23 国惠投资 MTN001B	债券	40,376,777.39	5.06%

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）
-	-	-	-

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	10257000000946146

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。