

华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 A 款

2023 年第 1 季度报告

重要信息提示：

- 1、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。
- 2、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：2023 年 01 月 01 日至 2023 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 A 款
理财产品代码	22115003
A 份额销售代码	22115003A
B 份额销售代码	22115003B
C 份额销售代码	22115003C
D 份额销售代码	22115003D
H 份额销售代码	22115003H
M 份额销售代码	22115003M
Z 份额销售代码	22115003Z
产品登记编码	Z7003922000023
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	PR1 级（低风险）
杠杆水平	100.56%
产品起始日期	2022-03-22
产品终止日期	无特定存续期限

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)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0265	895,131,251.28	1.0265	918,880,904.44	0.60%
2022-12-31	1.0204	1,142,959,809.88	1.0204	1,166,284,580.34	

B 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)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0175	2,908,499.76	1.0175	2,959,391.93	0.60%
2022-12-31	1.0114	2,118,865.46	1.0114	2,143,050.58	

C 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)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0197	2,448,198.18	1.0197	2,496,515.24	0.63%
2022-12-31	1.0133	2,404,487.75	1.0133	2,436,452.86	

D 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)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0276	90,712,198.75	1.0276	93,218,323.32	0.65%
2022-12-31	1.0210	74,274,364.50	1.0210	75,835,581.67	

H 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)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0207	188,825,429.26	1.0207	192,726,051.80	0.65%
2022-12-31	1.0141	254,177,525.87	1.0141	257,766,231.13	

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)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0227	277,611,693.08	1.0227	283,904,914.86	0.60%
2022-12-31	1.0166	389,292,124.08	1.0166	395,743,105.34	

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)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0143	397,837.39	1.0143	403,511.61	0.61%
2022-12-31	1.0082	3,019,278.96	1.0082	3,044,083.72	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*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	0.26%	68.97%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	27.33%
4	债券	0.00%	3.70%
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	99.74%	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”类别中包含永续债和优先股。

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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	410,739,957.15	27.33%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	173,031,389.65	11.51%
3	农行台州温岭支行 20(20220610)	现金及银行存款	101,403,345.15	6.75%
4	工行中山银苑支行 9.9(20220728)	现金及银行存款	99,978,145.90	6.65%
5	农业银行逸景翠园支行 20 (20230324)	现金及银行存款	98,953,594.88	6.58%
6	工商银行佛山高明沧江支行 9.9(20220630)	现金及银行存款	50,108,996.31	3.33%
7	工行中山西区支行 9.8(20220722)	现金及银行存款	49,509,571.11	3.29%
8	工行中山城北支行 9.7(20220722)	现金及银行存款	49,004,371.40	3.26%
9	农业江苏南京 23033002/20 亿	现金及银行存款	26,681,738.64	1.78%
10	农业江苏南京 23033003/20 亿	现金及银行存款	26,681,738.64	1.78%

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）
英大保险资产管理有限公司	YD-HLYJ OTC	英大资产活利壹玖 资产管理产品	买入	110,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC19KZ OTC	中诚信托嘉信配置 1 号集合资金信托计 划	买入	10,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC19RI OTC	中诚信托汇鑫 12 号 集合资金信托计划	买入	5,700,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC1A3M OTC	中诚信托汇鑫 16 号 集合资金信托计划	买入	245,300,000.00

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份份额分红	每万份现金分红
-	-	-

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	10257000000881041

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。