

华夏理财固定收益纯债最短持有 14 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 14 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115004
A 份额销售代码	22115004A
B 份额销售代码	22115004B
C 份额销售代码	22115004C
H 份额销售代码	22115004H
M 份额销售代码	22115004M
N 份额销售代码	22115004N
Z 份额销售代码	22115004Z
产品登记编码	Z7003922000024
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	105.41%
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	1.0231	569,441,393.14	1.0231	582,600,511.54	0.90%
2022-12-31	1.0140	664,203,387.28	1.0140	673,527,351.06	

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	1.0111	22,871,360.67	1.0111	23,124,560.85	0.90%
2022-12-31	1.0021	12,379,344.75	1.0021	12,405,439.27	

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	1.0140	590,463,562.67	1.0140	598,730,895.50	0.94%
2022-12-31	1.0046	878,382,501.01	1.0046	882,466,639.39	

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	1.0147	886,224,203.75	1.0147	899,287,227.12	0.95%
2022-12-31	1.0052	434,272,285.35	1.0052	436,546,097.82	

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	1.0130	135,781,694.42	1.0130	137,546,450.61	0.90%
2022-12-31	1.0040	74,472,130.08	1.0040	74,771,901.46	

N 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	1.0147	37,627,888.06	1.0147	38,179,478.32	0.96%
2022-12-31	1.0051	16,282,833.40	1.0051	16,366,543.16	

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	1.0043	183,095.27	1.0043	183,874.92	0.89%
2022-12-31	0.9954	392,468.75	0.9954	390,662.98	

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	3.02%	52.31%
2	同业存单	0.00%	8.76%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	11.28%
4	债券	0.00%	26.81%
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%	0.83%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	96.98%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	671,872,684.96	27.96%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	270,996,678.96	11.28%
3	18 国开 11	债券	113,210,141.67	4.71%
4	22 江苏银行 CD108	同业存单	99,272,395.50	4.13%
5	22 北京银行 CD153	同业存单	98,563,743.79	4.10%
6	22 南安 D1	债券	70,489,599.71	2.93%
7	农行台州温岭支行 20(20220610)	现金及银行存款	63,922,662.05	2.66%
8	工行中山银苑支行 9.9(20220728)	现金及银行存款	63,024,244.65	2.62%
9	农业银行逸景翠园支行 20 (20230324)	现金及银行存款	62,378,387.96	2.60%
10	工商银行佛山高明沧江支行 9.9(20220630)	现金及银行存款	31,587,719.64	1.31%

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	601082 OTC	英大资产-聚鑫 11 号 保险资管产品	买入	270,000,000.00
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	240,000,000.00

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	10257000000881052

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。