

华夏理财固定收益纯债最短持有 30 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 30 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115005
A 份额销售代码	22115005A
B 份额销售代码	22115005B
C 份额销售代码	22115005C
D 份额销售代码	22115005D
H 份额销售代码	22115005H
M 份额销售代码	22115005M
O 份额销售代码	22115005O
X 份额销售代码	22115005X
Z 份额销售代码	22115005Z
产品登记编码	Z7003922000025
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	106.58%
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	1.0260	546,196,941.00	1.0260	560,406,268.16	0.76%
2022-12-31	1.0183	567,179,571.41	1.0183	577,559,154.95	

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	1.0160	30,577,470.32	1.0160	31,067,087.84	0.76%
2022-12-31	1.0083	3,324,110.38	1.0083	3,351,798.68	

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	1.0222	86,012,401.12	1.0222	87,923,719.18	0.80%
2022-12-31	1.0141	154,314,245.53	1.0141	156,497,417.80	

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	1.0206	981,077,861.74	1.0206	1,001,258,233.94	0.80%
2022-12-31	1.0125	1,525,299,965.80	1.0125	1,544,389,868.67	

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	1.0186	1,769,352,139.81	1.0186	1,802,345,578.86	0.79%
2022-12-31	1.0106	1,499,158,027.42	1.0106	1,515,058,515.11	

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	1.0225	825,644,521.02	1.0225	844,191,294.91	0.80%
2022-12-31	1.0144	1,248,552,501.85	1.0144	1,266,522,716.42	

O 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	1.0095	17,562,615.79	1.0095	17,729,925.69	0.81%
2022-12-31	1.0014	1,005.00	1.0014	1,006.37	

X 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	1.0188	15,074,671.80	1.0188	15,357,550.96	0.81%
2022-12-31	1.0106	4,272,928.44	1.0106	4,318,175.61	

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	1.0091	173,060.77	1.0091	174,639.79	0.81%
2022-12-31	1.0010	1,000.00	1.0010	1,001.01	

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	0.09%	55.24%
2	同业存单	0.00%	4.33%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.77%
4	债券	0.00%	37.36%
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%	1.31%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.91%	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	1,113,182,657.31	23.95%
2	他行存款	现金及银行存款	480,874,858.40	10.35%
3	新华交行定存(2020)8号	现金及银行存款	89,650,643.97	1.93%
4	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	82,352,698.72	1.77%
5	新华工行佛山定存(2022)1号	现金及银行存款	78,808,515.66	1.70%
6	新华工行遵义定存(2022)1号	现金及银行存款	65,962,815.16	1.42%
7	新华建行东莞市分行1号	现金及银行存款	59,631,875.93	1.28%
8	新华广州定存(2021)1号	现金及银行存款	58,521,188.41	1.26%
9	20 光穗鲲鹏 ABN001 优先	债券	50,692,006.73	1.09%
10	新华交行定存(2021)3号	现金及银行存款	45,884,947.64	0.99%

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）
鲁能集团有限公司	136692.SH	16 鲁能 02	2,169,769.47

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	750,000,000.00

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	10257000000881063

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。