

华夏理财固定收益纯债最短持有 180 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 180 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115002
A 份额销售代码	22115002A
B 份额销售代码	22115002B
M 份额销售代码	22115002M
N 份额销售代码	22115002N
V 份额销售代码	22115002V
Z 份额销售代码	22115002Z
产品登记编码	Z7003922000011
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	116.51%
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	1.0308	1,395,104,919.28	1.0308	1,438,081,896.19	1.82%
2022-12-31	1.0124	2,052,336,927.44	1.0124	2,077,802,458.50	

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	1.0249	37,555,632.98	1.0249	38,489,258.89	1.82%
2022-12-31	1.0066	61,037,080.52	1.0066	61,438,421.32	

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	1.0189	136,062,118.01	1.0189	138,639,751.89	1.81%
2022-12-31	1.0008	220,195,026.85	1.0008	220,362,914.09	

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	1.0206	11,388,921.08	1.0206	11,623,270.69	1.87%
2022-12-31	1.0019	26,369,499.76	1.0019	26,418,761.88	

V 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	1.0087	2,507,062,806.88	1.0087	2,528,953,058.55	1.84%
2022-12-31	0.9905	2,507,062,806.88	0.9905	2,483,206,394.55	

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	1.0150	59,900,990.10	1.0150	60,802,013.58	1.89%
2022-12-31	0.9962	59,900,990.10	0.9962	59,672,726.75	

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	0.15%	27.96%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.60%
4	债券	0.00%	70.66%
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%	0.77%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.85%	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	307,021,136.32	6.25%
2	21 威宁投资 MTN001	债券	46,470,684.22	0.95%
3	建设银行唐山住房城建支行 24	现金及银行存款	43,237,537.84	0.88%
4	建设银行唐山住房城建支行 25	现金及银行存款	43,229,772.16	0.88%
5	20 光穗鲲鹏 ABN001 优先	债券	38,863,926.21	0.79%
6	易方达恒固 18 个月封闭债券 A	公募基金	37,470,928.74	0.76%
7	20 奉投 01	债券	29,579,808.78	0.60%
8	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	29,559,482.26	0.60%
9	建设银行唐山住房城建支行 01	现金及银行存款	28,835,379.48	0.59%
10	建设银行唐山住房城建支行 02	现金及银行存款	28,835,379.48	0.59%

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）
招商证券股份有限公司	032380258.IB	23 常德城投 PPN004	7,052,798.97

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）
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	235,000,000.00

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,合理配置货币类、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

无。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000881212

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。