

华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 96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：中国农业银行股份有限公司

报 告 期：2024年1月25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 96 号 |
| 理财产品代码 | 23111096 |
| 产品登记编码 | Z7003923000471 |
| 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 | 100.04% |
| 产品起始日期 | 2024-01-25 |
| 产品终止日期 | 2024-06-26 |

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 | 1.0045 | 246,527,549.00 | 1.0045 | 247,628,107.82 | 0.45% |
| 2024-01-25 | 1.0000 | - | 1.0000 | - | |

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 | 0.03% | 100.00% |
| 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% | 0.00% |
| 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 | 99.97% | 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 | 中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026-40 | 现金及银行存款 | 55,095,589.14 | 22.24% |
| 2 | 建行张家界桑植支行 20230824-15 | 现金及银行存款 | 24,762,027.68 | 10.00% |
| 3 | 建行邵阳城南支行 20230824-15 | 现金及银行存款 | 24,762,027.68 | 10.00% |
| 4 | 建行常德武陵支行 20230824-10 | 现金及银行存款 | 16,508,018.43 | 6.66% |
| 5 | 建行湘西吉首支行 20230824-10 | 现金及银行存款 | 16,508,018.43 | 6.66% |
| 6 | 建行连云港分行 20230829-10-1 | 现金及银行存款 | 13,836,962.64 | 5.59% |
| 7 | 建行连云港分行 20230829-10-2 | 现金及银行存款 | 13,836,962.64 | 5.59% |
| 8 | 建行连云港分行 20230829-10-3 | 现金及银行存款 | 13,836,962.64 | 5.59% |
| 9 | 建行连云港分行 20230829-10-4 | 现金及银行存款 | 13,836,962.64 | 5.59% |
| 10 | 中行常熟分行 20231024-10 | 现金及银行存款 | 13,776,126.79 | 5.56% |

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 | 30050101040032109 |

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。