

华夏理财固定收益纯债最短持有7天理财产品 A 款

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：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2024 年 1 月 1 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
O 份额销售代码	22115003O
W 份额销售代码	22115003W
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	104.16%
产品起始日期	2022-03-22
产品终止日期	无特定存续期限

注：由于子份额可能存在募集金额或存续金额为 0，导致无持有人的情形，本报告仅列示报告期末存续金额不为 0 的相关子份额信息。

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0541	636,400,138.12	1.0541	670,857,099.04	0.64%
2023-12-31	1.0474	926,368,993.23	1.0474	970,263,978.17	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0449	455,132,242.24	1.0449	475,574,070.71	0.65%
2023-12-31	1.0382	633,080,945.16	1.0382	657,271,179.32	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0487	167,780,383.72	1.0487	175,958,723.30	0.68%
2023-12-31	1.0416	240,539,858.31	1.0416	250,551,374.74	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0568	41,497,204,353.68	1.0568	43,855,823,723.19	0.68%
2023-12-31	1.0497	34,623,143,232.95	1.0497	36,342,685,795.81	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0502	1,180,609,076.51	1.0502	1,239,879,191.48	0.69%
2023-12-31	1.0430	1,595,138,589.06	1.0430	1,663,709,061.56	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0502	285,310,346.44	1.0502	299,632,518.54	0.64%
2023-12-31	1.0435	564,733,049.05	1.0435	589,279,534.24	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0167	655,897,678.03	1.0167	666,854,950.06	0.69%
2023-12-31	1.0097	976,333,522.35	1.0097	985,784,111.20	

W 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0111	2,083,583.74	1.0111	2,106,632.29	0.63%
2023-12-31	1.0048	1,065,644.04	1.0048	1,070,746.91	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0400	117,764.36	1.0400	122,476.84	0.53%
2023-12-31	1.0345	7,023,270.05	1.0345	7,265,320.78	

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	0.00%	79.56%
2	同业存单	0.00%	1.54%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.24%
4	债券	0.00%	17.20%
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%	1.46%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	100.00%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	4,754,114,845.02	9.63%
2	农行台州温岭支行 20(20220610)	现金及银行存款	863,358,036.20	1.75%
3	工行中山银苑支行 9.9(20220728)	现金及银行存款	851,327,798.04	1.72%
4	农业银行逸景翠园支行 20 (20230324)	现金及银行存款	843,333,133.98	1.71%
5	农业银行南京江宁支行 202310279758	现金及银行存款	729,233,618.75	1.48%
6	中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026-40	现金及银行存款	534,594,375.01	1.08%
7	中行南京河西支行 20231107-35	现金及银行存款	514,818,867.36	1.04%
8	19 民生银行永续债	债券	456,473,415.43	0.92%
9	工商银行佛山高明沧江支行 9.9(20220630)	现金及银行存款	426,654,590.88	0.86%
10	农业银行清远分行 202307207337	现金及银行存款	423,477,846.13	0.86%

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）
中国建设银行股份有限 公司	092280083	22 建行永续债 01	10,292,113.83

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	143948	国贸 1 优 2	2,250,015.17

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 资产管理产品	买入	925,700,000.00
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	370,000,000.00

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	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。