

华夏理财固定收益纯债最短持有 60 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 60 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码 | 22115006 |
| A 份额销售代码 | 22115006A |
| B 份额销售代码 | 22115006B |
| C 份额销售代码 | 22115006C |
| E 份额销售代码 | 22115006E |
| M 份额销售代码 | 22115006M |
| N 份额销售代码 | 22115006N |
| Z 份额销售代码 | 22115006Z |
| 产品登记编码 | Z7003922000026 |
| 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 | 101.01% |
| 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 | 1.0561 | 563,791,997.66 | 1.0561 | 595,396,887.16 | 0.62% |
| 2023-12-31 | 1.0496 | 820,680,111.08 | 1.0496 | 861,373,521.76 | |

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 | 1.0429 | 19,650,393.94 | 1.0429 | 20,493,904.51 | 0.62% |
| 2023-12-31 | 1.0365 | 25,856,674.38 | 1.0365 | 26,801,052.48 | |

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 | 1.0471 | 1,259,776,762.12 | 1.0471 | 1,319,154,536.83 | 0.65% |
| 2023-12-31 | 1.0403 | 1,566,651,800.87 | 1.0403 | 1,629,812,153.13 | |

E 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 | 1.0593 | 86,045,578.87 | 1.0593 | 91,151,864.13 | 0.66% |
| 2023-12-31 | 1.0524 | 115,443,343.49 | 1.0524 | 121,489,181.68 | |

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 | 1.0440 | 228,296,708.78 | 1.0440 | 238,335,017.62 | 0.62% |
| 2023-12-31 | 1.0376 | 431,686,105.53 | 1.0376 | 447,903,544.37 | |

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) | 期间净值增 长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-------------|
| 2024-03-31 | 1.0478 | 10,512,114.19 | 1.0478 | 11,014,818.43 | 0.67% |
| 2023-12-31 | 1.0408 | 18,902,068.64 | 1.0408 | 19,674,020.31 | |

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 | 1.0001 | 200,000,000.00 | 1.0001 | 200,017,573.33 | 0.01% |
| 2024-03-29 | 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 | 0.00% | 86.22% |
| 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% | 12.43% |
| 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% | 1.35% |
| 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 | 354,315,405.74 | 14.17% |
| 2 | 中行南京河西支行 20231107-35 | 现金及银行存款 | 186,992,669.46 | 7.48% |
| 3 | 农业银行南京江宁支行 202310279758 | 现金及银行存款 | 150,037,925.95 | 6.00% |
| 4 | 中行徐州分行 20231107-15 | 现金及银行存款 | 80,149,220.10 | 3.21% |
| 5 | 农行珠海分行 20230927-10 | 现金及银行存款 | 53,592,742.25 | 2.14% |
| 6 | 建行淮安楚州支行 20230927-10 | 现金及银行存款 | 53,592,742.25 | 2.14% |
| 7 | 建行淮安洪泽支行 20230927-10 | 现金及银行存款 | 53,592,742.25 | 2.14% |
| 8 | 农业银行东莞御园支行 202311012115 | 现金及银行存款 | 50,008,604.91 | 2.00% |
| 9 | 农业银行东莞高 支行 202311010946 | 现金及银行存款 | 50,008,604.91 | 2.00% |
| 10 | 中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026-40 | 现金及银行存款 | 44,923,098.70 | 1.80% |

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） |
|----------------|------------|--------------------------|------|---------------|
| 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 | 49,000,000.00 |

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 | 10257000000881074 |

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。