

华夏理财固定收益纯债最短持有 90 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 90 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115001
A 份额销售代码	22115001A
B 份额销售代码	22115001B
C 份额销售代码	22115001C
M 份额销售代码	22115001M
S 份额销售代码	22115001S
产品登记编码	Z7003922000010
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	100.86%
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	1.0628	982,723,722.62	1.0628	1,044,406,534.71	0.72%
2023-12-31	1.0552	983,534,751.41	1.0552	1,037,832,246.95	

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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0570	85,064,775.10	1.0570	89,912,583.19	0.71%
2023-12-31	1.0495	79,101,019.09	1.0495	83,013,950.71	

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	1.0538	158,911,602.00	1.0538	167,462,541.16	0.76%
2023-12-31	1.0459	130,685,093.21	1.0459	136,686,320.37	

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	1.0506	317,477,963.84	1.0506	333,550,458.97	0.71%
2023-12-31	1.0432	433,764,930.13	1.0432	452,482,401.22	

S 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	1.0160	40,854,036.85	1.0160	41,508,830.01	0.75%
2023-12-31	1.0084	11,490,447.77	1.0084	11,586,788.33	

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	1.71%	70.26%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.45%
4	债券	0.00%	26.00%
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%	3.29%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.29%	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	206,021,202.16	12.18%
2	中行南京河西支行 20231107-35	现金及银行存款	126,490,720.14	7.48%
3	中行徐州分行 20231107-15	现金及银行存款	54,216,738.01	3.21%
4	农行东莞厚街支行 20231114-20	现金及银行存款	37,236,388.87	2.20%
5	农行东莞塘厦支行 20231114-20	现金及银行存款	37,236,388.87	2.20%
6	农行珠海分行 20230927-10	现金及银行存款	36,252,675.47	2.14%
7	建行淮安楚州支行 20230927-10	现金及银行存款	36,252,675.47	2.14%
8	建行淮安洪泽支行 20230927-10	现金及银行存款	36,252,675.47	2.14%
9	汇添富长添利定期开放债券 A	公募基金	28,656,294.03	1.69%
10	农行东莞凤岗支行 20231110-15	现金及银行存款	27,925,985.78	1.65%

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

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对可能出现的流动性风险。

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，产品投资的债券资产总体资质较优。产品组合久期控制在合理范围内，债券资产价格波动对组合净值影响保持在可控范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本无权益类资产持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品仓位

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000881085

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。