

# 华夏理财固定收益增强最短持有 180 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	华夏理财固定收益增强最短持有 180 天理财产品 A 款
理财产品代码	22135003
A 份额销售代码	22135003A
C 份额销售代码	22135003C
H 份额销售代码	22135003H
V 份额销售代码	22135003V
Y 份额销售代码	22135003Y
Z 份额销售代码	22135003Z
产品登记编码	Z7003922000015
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	111.14%
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	1.0748	3,015,899,949.53	1.0748	3,241,430,719.09	1.14%
2023-12-31	1.0627	3,007,754,336.10	1.0627	3,196,193,417.42	

### 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	1.0541	2,415,520,806.87	1.0541	2,546,154,819.01	1.14%
2023-12-31	1.0422	2,320,330,071.44	1.0422	2,418,216,084.15	

### 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	1.0525	1,150,845,593.76	1.0525	1,211,227,537.61	1.17%
2023-12-31	1.0403	1,205,043,525.42	1.0403	1,253,666,908.31	

### 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0508	67,689,115.06	1.0508	71,130,040.33	1.14%
2023-12-31	1.0390	77,423,827.85	1.0390	80,443,862.69	

### Y 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	1.0547	2,320,056.54	1.0547	2,446,928.66	1.19%
2023-12-31	1.0423	2,621,917.54	1.0423	2,732,743.97	

## 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	1.0522	110,793.00	1.0522	116,574.71	1.12%
2023-12-31	1.0405	31,255.95	1.0405	32,522.81	

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	0.51%	20.11%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.31%
4	债券	0.00%	73.40%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	2.12%
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%	4.07%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.49%	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	899,123,140.93	11.44%
2	22 青岛银行永续债 02	债券	114,972,117.60	1.46%
3	银华中债 1-3 年国开行债券指数 D	公募基金	100,664,946.20	1.28%
4	民生优 1	权益类投资	93,705,500.05	1.19%
5	24 保利发展 MTN003	债券	92,435,734.72	1.18%
6	19 上饶 01	债券	78,873,810.68	1.00%
7	23 水利十一 MTN001(可持续挂钩)	债券	74,139,300.90	0.94%
8	21 华租 03	债券	72,090,781.36	0.92%
9	农行天津滨海分行 20230906/12	现金及银行存款	71,067,113.28	0.90%
10	交银稳利中短债债券 A	公募基金	68,845,317.78	0.88%

### 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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系最短持有期产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

### 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，整体波动率在合理区间范围内。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品持有的权益类资产价格波动均处于合理区间范围内。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

## 第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000881336

## 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。