

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 A 款

## 2023 年第 4 季度报告

### 重要信息提示：

- 1、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。
- 2、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：2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 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     | 103.07%                    |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)         | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|------------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0474      | 926,368,993.23 | 1.0474      | 970,263,978.17   | 0.72%         |
| 2023-09-30 | 1.0399      | 971,614,532.90 | 1.0399      | 1,010,352,378.18 |               |

### B 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0382      | 633,080,945.16 | 1.0382      | 657,271,179.32 | 0.72%         |
| 2023-09-30 | 1.0308      | 240,319,740.90 | 1.0308      | 247,711,479.00 |               |

### C 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0416      | 240,539,858.31 | 1.0416      | 250,551,374.74 | 0.76%         |
| 2023-09-30 | 1.0337      | 50,111,533.56  | 1.0337      | 51,802,608.06  |               |

### D 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)          | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)          | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|-------------------|-------------|-------------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0497      | 34,623,143,232.95 | 1.0497      | 36,342,685,795.81 | 0.77%         |
| 2023-09-30 | 1.0417      | 640,778,691.41    | 1.0417      | 667,527,701.67    |               |

### H 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)         | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)         | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0430      | 1,595,138,589.06 | 1.0430      | 1,663,709,061.56 | 0.77%         |
| 2023-09-30 | 1.0350      | 970,715,190.34   | 1.0350      | 1,004,669,093.16 |               |

**M 份额：**

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0435      | 564,733,049.05 | 1.0435      | 589,279,534.24 | 0.72%         |
| 2023-09-30 | 1.0360      | 195,450,013.89 | 1.0360      | 202,477,168.32 |               |

**O 份额：**

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0097      | 976,333,522.35 | 1.0097      | 985,784,111.20 | 0.79%         |
| 2023-09-30 | 1.0018      | 54,996.00      | 1.0018      | 55,093.17      |               |

**W 份额：**

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)     | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)     | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|--------------|-------------|--------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0048      | 1,065,644.04 | 1.0048      | 1,070,746.91 | 0.48%         |
| 2023-10-27 | 1.0000      | -            | 1.0000      | -            |               |

**Z 份额：**

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)     | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)     | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|--------------|-------------|--------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.0345      | 7,023,270.05 | 1.0345      | 7,265,320.78 | 0.68%         |
| 2023-09-30 | 1.0275      | 6,880,134.69 | 1.0275      | 7,069,595.90 |               |

注：期间累计净值增长率=（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       | 0.01%     | 81.45%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.94%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 2.62%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 14.72%    |
| 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%     | 0.25%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.99%    | 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<br>(元)      | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------------------|-----------------|------------------|-------------|
| 1  | 存款及清算款等现金类资产               | 现金及银行存款         | 5,945,150,349.09 | 13.91%      |
| 2  | 中行南京河西支行 20231107-35       | 现金及银行存款         | 1,433,569,067.90 | 3.35%       |
| 3  | 债券买入返售                     | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 1,121,186,173.04 | 2.62%       |
| 4  | 农业银行南京江宁支行<br>202310279758 | 现金及银行存款         | 724,078,068.94   | 1.69%       |
| 5  | 中行徐州分行 20231107-15         | 现金及银行存款         | 614,414,776.47   | 1.44%       |
| 6  | 19 民生银行永续债                 | 债券              | 509,105,518.61   | 1.19%       |
| 7  | 建行溧阳嘉丰支行 20231215-35       | 现金及银行存款         | 437,099,238.63   | 1.02%       |
| 8  | 农行珠海分行 20230927-10         | 现金及银行存款         | 410,917,557.31   | 0.96%       |
| 9  | 建行淮安楚州支行 20230927-10       | 现金及银行存款         | 410,917,557.31   | 0.96%       |
| 10 | 建行淮安洪泽支行 20230927-10       | 现金及银行存款         | 410,917,557.31   | 0.96%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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）       |
|------------------|--------|----------|---------------|
| 首创证券股份有限公司       | 253203 | 23 首创 C2 | 81,102,126.03 |
| 兴业国信资产管理有限<br>公司 | 114548 | 22 兴信 01 | 14,993,828.52 |

#### 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）       |
|------------|--------|----------|---------------|
| 国信证券股份有限公司 | 253200 | 23 赣江 02 | 18,258,793.03 |

#### 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<br>限责任公司 | ZC19RI OTC | 中诚信托-汇鑫 12 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 700,000,000.00 |

#### 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。