

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 B 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 B 款 |
| 理财产品代码  | 22115008                   |
| 产品登记编码  | Z7003922000045             |
| 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    | 112.98%                    |
| 产品起始日期  | 2022-04-25                 |
| 产品终止日期  | 无特定存续期限                    |

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

| 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 | 1.0513      | 2,684,047,306.95 | 1.0513      | 2,821,678,763.60 | 0.81%         |
| 2023-09-30 | 1.0429      | 2,357,969,367.46 | 1.0429      | 2,459,148,238.74 |               |

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       | 0.31%     | 54.75%    |
| 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%     | 45.25%    |
| 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%     | 0.00%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.69%    | 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 | 221,736,491.63 | 6.96%       |
| 2  | 19 民生银行永续债                    | 债券      | 157,441,630.40 | 4.94%       |
| 3  | 建设银行秦皇岛港口专业支行<br>202305125604 | 现金及银行存款 | 73,023,810.05  | 2.29%       |
| 4  | 建设银行秦皇岛港口专业支行<br>202305125605 | 现金及银行存款 | 73,023,810.05  | 2.29%       |
| 5  | 光大银行福州分行 202305197464         | 现金及银行存款 | 72,956,496.11  | 2.29%       |
| 6  | 光大银行福州分行 202305197465         | 现金及银行存款 | 72,956,496.11  | 2.29%       |
| 7  | 光大银行福州分行 202305197466         | 现金及银行存款 | 72,956,496.11  | 2.29%       |
| 8  | 光大银行福州分行 202305197467         | 现金及银行存款 | 72,956,496.11  | 2.29%       |
| 9  | 建设银行唐山住房城建支行 24               | 现金及银行存款 | 44,011,772.66  | 1.38%       |
| 10 | 建设银行唐山住房城建支行 25               | 现金及银行存款 | 44,004,058.42  | 1.38%       |

### 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 | 15,145,072.43 |
| 兴业国信资产管理有限<br>公司 | 114548 | 22 兴信 01 | 894,759.36    |

#### 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 | 2,932,052.88 |

#### 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 | 10257000000886276 |

## 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。