

华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 3 号

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型日日开理财产品 3 号 |
| 理财产品代码 | 23112003 |
| A 份额销售代码 | 23112003A |
| E 份额销售代码 | 23112003E |
| F 份额销售代码 | 23112003F |
| Q 份额销售代码 | 23112003Q |
| U 份额销售代码 | 23112003U |
| V 份额销售代码 | 23112003V |
| Z 份额销售代码 | 23112003Z |
| 产品登记编码 | Z7003923000369 |
| 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 | 100.49% |
| 产品起始日期 | 2023-09-11 |
| 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 | 1.0156 | 4,626,693,663.79 | 1.0156 | 4,699,019,548.80 | 0.67% |
| 2023-12-31 | 1.0088 | 7,898,098,811.72 | 1.0088 | 7,967,212,952.04 | |

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 | 1.0147 | 325,688,653.78 | 1.0147 | 330,478,326.63 | 0.64% |
| 2023-12-31 | 1.0082 | 567,698,392.55 | 1.0082 | 572,346,163.49 | |

F 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 | 1.0131 | 973,514,925.93 | 1.0131 | 986,219,835.62 | 0.68% |
| 2023-12-31 | 1.0063 | 1,416,070,918.12 | 1.0063 | 1,424,968,712.91 | |

Q 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 | 1.0154 | 343,132,242.90 | 1.0154 | 348,401,019.87 | 0.67% |
| 2023-12-31 | 1.0086 | 584,010,148.92 | 1.0086 | 589,018,216.88 | |

U 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 | 1.0152 | 926,522,064.31 | 1.0152 | 940,590,568.97 | 0.64% |
| 2023-12-31 | 1.0087 | 1,955,496,382.16 | 1.0087 | 1,972,508,685.43 | |

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 | 1.0156 | 1,228,208,779.95 | 1.0156 | 1,247,423,568.11 | 0.68% |
| 2023-12-31 | 1.0087 | 2,197,388,569.23 | 1.0087 | 2,216,602,614.94 | |

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 | 1.0169 | 6,509,133.01 | 1.0169 | 6,618,996.37 | 0.70% |
| 2023-12-31 | 1.0098 | 10,209,370.45 | 1.0098 | 10,309,763.03 | |

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 | 0.04% | 94.82% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.05% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.01% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 4.61% |
| 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% | 0.50% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 99.96% | 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 | 729,023,336.00 | 8.48% |
| 2 | 农业银行南京江宁支行 202310279758 | 现金及银行存款 | 702,273,812.80 | 8.17% |
| 3 | 中行雄县支行 20240208-30 | 现金及银行存款 | 525,192,058.29 | 6.11% |
| 4 | 中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026-40 | 现金及银行存款 | 476,472,015.10 | 5.54% |
| 5 | 农业银行东莞御园支行 202311012115 | 现金及银行存款 | 234,072,374.83 | 2.72% |
| 6 | 农业银行东莞高 支行 202311010946 | 现金及银行存款 | 234,072,374.83 | 2.72% |
| 7 | 农行台州温岭支行 20(20220610) | 现金及银行存款 | 166,840,549.20 | 1.94% |
| 8 | 工行中山银苑支行 9.9(20220728) | 现金及银行存款 | 164,515,752.93 | 1.91% |
| 9 | 农业银行逸景翠园支行 20 (20230324) | 现金及银行存款 | 162,970,815.51 | 1.89% |
| 10 | 中行扬州分行 20231031-20 | 现金及银行存款 | 145,701,425.31 | 1.69% |

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) |
|--------------|-----------|----------------|---------------|
| 平安银行股份有限公司 | 2028003 | 20 平安银行永续债 01 | 51,556,479.15 |
| 平安银行股份有限公司 | 2128036 | 21 平安银行二级 | 20,167,011.79 |
| 平安银行股份有限公司 | 2428002 | 24 平安银行三农债 01 | 48,554,789.23 |
| 兴业银行股份有限公司 | 2128032 | 21 兴业银行二级 01 | 10,142,060.69 |
| 兴业银行股份有限公司 | 2128042 | 21 兴业银行二级 02 | 30,177,878.90 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 092280131 | 22 建行二级资本债 02A | 9,552,133.95 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 232480006 | 24 建行二级资本债 01A | 1,015,435.41 |

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) |
|------------|--------|----------|---------------|
| 方正证券股份有限公司 | 177993 | 21 香投 01 | 32,240,587.69 |
| 招商证券股份有限公司 | 143948 | 国贸 1 优 2 | 23,981.32 |

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) |
|--------------|------------|------------------------|------|---------------|
| 英大保险资产管理有限公司 | 601082 OTC | 英大资产-聚鑫 11 号 资产管理产品 | 买入 | 87,300,000.00 |

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。

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

本产品持仓信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生，价格波动可控。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|------------------|
| 1 | 托管账户 | 1025700000944365 |

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。