

华夏理财固定收益纯债最短持有 30 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 30 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115005
A 份额销售代码	22115005A
B 份额销售代码	22115005B
C 份额销售代码	22115005C
D 份额销售代码	22115005D
H 份额销售代码	22115005H
M 份额销售代码	22115005M
N 份额销售代码	22115005N
O 份额销售代码	22115005O
X 份额销售代码	22115005X
Z 份额销售代码	22115005Z
产品登记编码	Z7003922000025
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	109.58%
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	1.0537	242,798,061.35	1.0537	255,829,743.32	0.64%
2023-12-31	1.0470	253,779,383.49	1.0470	265,714,699.83	

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	1.0434	2,297,930.84	1.0434	2,397,715.76	0.64%
2023-12-31	1.0368	8,223,371.74	1.0368	8,525,825.09	

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	1.0514	56,166,282.73	1.0514	59,051,858.33	0.67%
2023-12-31	1.0444	55,358,494.06	1.0444	57,814,085.60	

D 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	1.0496	584,133,416.54	1.0496	613,087,431.33	0.66%
2023-12-31	1.0427	651,330,749.97	1.0427	679,115,311.53	

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	1.0468	280,382,840.38	1.0468	293,496,452.28	0.65%
2023-12-31	1.0400	364,459,423.77	1.0400	379,042,234.94	

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	1.0516	664,114,390.45	1.0516	698,387,235.38	0.67%
2023-12-31	1.0446	818,892,115.82	1.0446	855,405,564.96	

N 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	1.0244	4,999,612.94	1.0244	5,121,422.82	0.69%
2023-12-31	1.0174	6,543,847.74	1.0174	6,657,763.31	

O 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	1.0388	425,568,699.16	1.0388	442,090,481.91	0.68%
2023-12-31	1.0318	566,472,145.41	1.0318	584,463,661.38	

X 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	1.0483	16,105,767.88	1.0483	16,883,887.33	0.68%
2023-12-31	1.0412	19,567,319.59	1.0412	20,373,339.02	

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	1.0392	1,671,598.91	1.0392	1,737,201.58	0.68%
2023-12-31	1.0322	2,213,285.26	1.0322	2,284,500.08	

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%	61.89%
2	同业存单	0.00%	0.40%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.20%
4	债券	0.00%	34.67%
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%	0.84%
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	定期存款	现金及银行存款	496,553,309.30	18.98%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	164,961,246.07	6.30%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	57,625,515.96	2.20%
4	农行东莞厚街支行 20231114-20	现金及银行存款	23,287,986.12	0.89%
5	农行东莞塘厦支行 20231114-20	现金及银行存款	23,287,986.12	0.89%
6	24 保利 01	债券	21,876,412.76	0.84%
7	24 鹤投 01	债券	21,856,890.36	0.84%
8	中交 07A	债券	21,404,305.11	0.82%
9	信保 03 优	债券	20,769,235.88	0.79%
10	31ZL8A2	债券	18,464,707.20	0.71%

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）
中诚信托有 限责任公司	ZC1A34 OTC	中诚信托-汇鑫 15 号 集合资金信托计划	买入	415,600,000.00

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,合理配置货币类、债券类,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,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

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	10257000000881063

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。