

# 华夏理财固定收益纯债型半年定开理财产品 1 号

## 2023 年第 1 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 01 月 01 日至 2023 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半年定开理财产品 1 号 |
| 理财产品代码   | 21113201                |
| A 份额销售代码 | 21113201A               |
| B 份额销售代码 | 21113201B               |
| 产品登记编码   | Z7003921000461          |
| 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     | 119.40%                 |
| 产品起始日期   | 2021-11-23              |
| 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

### 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-03-31 | 1.0415      | 845,095,568.87 | 1.0415      | 880,161,746.99 | 1.91%         |
| 2022-12-31 | 1.0220      | 845,095,568.87 | 1.0220      | 863,690,837.53 |               |

### 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-03-31 | 1.0426      | 139,502,617.97 | 1.0426      | 145,444,737.29 | 1.94%         |
| 2022-12-31 | 1.0228      | 139,502,617.97 | 1.0228      | 142,687,776.65 |               |

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值\*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       | 0.76%     | 6.73%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 2.33%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 87.44%    |
| 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%     | 3.51%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.24%    | 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”类别中包含永续债和优先股。

### 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 | 82,372,347.94 | 6.73%       |
| 2  | 20 乌经建            | 债券      | 30,091,364.61 | 2.46%       |
| 3  | 中欧短债 A            | 公募基金    | 28,620,942.94 | 2.34%       |
| 4  | 22 汉口银行 CD068     | 同业存单    | 28,525,945.16 | 2.33%       |
| 5  | 20 淮南建发 MTN002    | 债券      | 25,140,369.62 | 2.05%       |
| 6  | 20 邯郸交建 PPN005    | 债券      | 25,096,879.85 | 2.05%       |
| 7  | 20 轻纺 01          | 债券      | 24,871,247.54 | 2.03%       |
| 8  | 20 光穗鲲鹏 ABN001 优先 | 债券      | 17,744,778.15 | 1.45%       |
| 9  | 20 城建 01          | 债券      | 16,162,086.60 | 1.32%       |
| 10 | 20 黄石城投 PPN003    | 债券      | 14,936,234.79 | 1.22%       |

### 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） |
|-------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -       |

#### 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）      |
|------------|--------------|----------------|--------------|
| 招商证券股份有限公司 | 032380258.IB | 23 常德城投 PPN004 | 2,989,313.72 |

#### 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 | ZC19HA OTC | 中诚信托嘉信 11 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 205,000,000.00 |

## 第四章 收益分配情况

| 除权日期 | 每万份份额分红 | 每万份现金分红 |
|------|---------|---------|
| -    | -       | -       |

## **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**

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 | 10257000000857018 |

## **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。