

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 60 天理财 产品 A 款

## 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最短持有 60 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码   | 22115006                    |
| A 份额销售代码 | 22115006A                   |
| B 份额销售代码 | 22115006B                   |
| C 份额销售代码 | 22115006C                   |
| E 份额销售代码 | 22115006E                   |
| M 份额销售代码 | 22115006M                   |
| N 份额销售代码 | 22115006N                   |
| 产品登记编码   | Z7003922000026              |
| 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     | 116.88%                     |
| 产品起始日期   | 2022-03-22                  |
| 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 | 1.0261      | 1,578,036,101.18 | 1.0261      | 1,619,258,075.01 | 1.41%         |
| 2022-12-31 | 1.0118      | 1,351,070,166.20 | 1.0118      | 1,366,968,004.19 |               |

### 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 | 1.0133      | 34,560,915.68 | 1.0133      | 35,021,939.11 | 1.41%         |
| 2022-12-31 | 0.9992      | 44,861,185.77 | 0.9992      | 44,823,500.91 |               |

### 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-03-31 | 1.0159      | 591,771,043.22 | 1.0159      | 601,177,452.87 | 1.46%         |
| 2022-12-31 | 1.0013      | 616,880,407.11 | 1.0013      | 617,691,180.18 |               |

### E 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 | 1.0273      | 3,948,134.44 | 1.0273      | 4,055,739.92 | 1.47%         |
| 2022-12-31 | 1.0124      | 6,152,226.19 | 1.0124      | 6,228,393.24 |               |

### 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-03-31 | 1.0143      | 27,831,706.81 | 1.0143      | 28,230,910.62 | 1.41%         |
| 2022-12-31 | 1.0002      | 42,169,916.86 | 1.0002      | 42,176,481.60 |               |

**N 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 | 1.0160      | 97,388,946.41 | 1.0160      | 98,951,493.91 | 1.47%         |
| 2022-12-31 | 1.0013      | 12,372,231.61 | 1.0013      | 12,388,612.28 |               |

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       | 1.46%     | 19.42%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 2.17%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.37%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 76.25%    |
| 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%     | 1.79%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 98.54%    | 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 | 229,877,549.90 | 8.24%       |
| 2  | 20 光穗鲲鹏 ABN001 优先 | 债券      | 48,495,417.42  | 1.74%       |
| 3  | 21 襄阳 01          | 债券      | 28,717,057.32  | 1.03%       |
| 4  | 21 江东控股 PPN002    | 债券      | 25,525,357.34  | 0.92%       |
| 5  | 20 广丰 01          | 债券      | 21,400,409.70  | 0.77%       |
| 6  | 22 北京银行 CD126     | 同业存单    | 21,057,211.16  | 0.75%       |
| 7  | 中欧货币 D            | 公募基金    | 20,412,408.16  | 0.73%       |
| 8  | 20 绵交 01          | 债券      | 16,104,481.14  | 0.58%       |
| 9  | 21 中建投租 MTN001    | 债券      | 15,822,918.48  | 0.57%       |
| 10 | 20 飞驰创信 ABN001 优先 | 债券      | 15,088,049.58  | 0.54%       |

### 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 | 600,112.13 |

#### 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 | YD-HLYJ<br>OTC | 英大资产活利壹玖<br>资产管理产品      | 买入   | 220,000,000.00 |
| 中诚信托有限责任公司   | ZC19HA OTC     | 中诚信托嘉信 11 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 210,000,000.00 |
| 中诚信托有限责任公司   | ZC19RI OTC     | 中诚信托汇鑫 12 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 1,000,000.00   |

#### 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 | 10257000000881074 |

## **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。