

华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 2 号

2024 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：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 2 号
理财产品代码	23112002
A 份额销售代码	23112002A
F 份额销售代码	23112002F
K 份额销售代码	23112002K
M 份额销售代码	23112002M
P 份额销售代码	23112002P
S 份额销售代码	23112002S
产品登记编码	Z7003923000076
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	100.56%
产品起始日期	2023-03-21
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	1.0269	1,734,726,233.37	1.0269	1,781,377,124.81	0.65%
2023-12-31	1.0203	3,259,607,386.67	1.0203	3,325,923,957.46	

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	1.0257	104,839,018.97	1.0257	107,534,299.87	0.61%
2023-12-31	1.0195	78,700,219.09	1.0195	80,237,888.88	

K 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	1.0097	710,601,462.37	1.0097	717,489,643.59	0.63%
2023-12-31	1.0034	177,589,040.93	1.0034	178,186,722.34	

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	1.0104	11,898,041.60	1.0104	12,021,770.47	0.66%
2023-12-31	1.0038	24,554,659.50	1.0038	24,648,906.67	

P 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	1.0123	80,877,619.12	1.0123	81,871,327.46	0.63%
2023-12-31	1.0060	43,639,800.47	1.0060	43,899,828.78	

S 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	1.0139	274,041,615.76	1.0139	277,851,515.16	0.66%
2023-12-31	1.0073	241,474,697.83	1.0073	243,238,455.87	

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	0.36%	96.53%
2	同业存单	0.00%	0.02%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.33%
4	债券	0.00%	3.11%
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	99.64%	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	328,526,876.61	10.97%
2	中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026-40	现金及银行存款	249,877,715.01	8.34%
3	中行扬州分行 20231031-20	现金及银行存款	110,343,517.86	3.68%
4	中行常州武进支行 20231107-15	现金及银行存款	82,737,243.12	2.76%
5	建行连云港分行 20230829-10-1	现金及银行存款	62,755,452.12	2.10%
6	建行连云港分行 20230829-10-2	现金及银行存款	62,755,452.12	2.10%
7	建行连云港分行 20230829-10-3	现金及银行存款	62,755,452.12	2.10%
8	建行连云港分行 20230829-10-4	现金及银行存款	62,755,452.12	2.10%
9	中行常熟分行 20231024-10	现金及银行存款	62,479,540.32	2.09%
10	建行南通如皋支行 20230921-10	现金及银行存款	55,350,438.37	1.85%

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	zcxthx18 OTC	中诚信托-汇鑫 18 号 集合资金信托计划	买入	190,000,000.00

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

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是本产品为日开产品，投资以存款、同业存单、流动性较好的中高等级信用债为主，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

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，产品持仓债券价格波动处于市场合理区间范围内。

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	10250000003344250

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。