

华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 118号

2024年第2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：中国农业银行股份有限公司

报 告 期：2024年6月6日至2024年6月30日

第一章 基本信息

| | |
|---------|--------------------------|
| 产品名称 | 华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 118 号 |
| 理财产品代码 | 24111118 |
| 产品登记编码 | Z7003924000070 |
| 产品募集方式 | 公募 |
| 产品运作模式 | 封闭式 |
| 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 | 100.02% |
| 产品起始日期 | 2024-06-06 |
| 产品终止日期 | 2024-09-11 |

第二章 净值、存续规模及收益表现

2.1 净值和存续规模

| 估值日期 | 份额净值 (元) | 份额总数(份) | 累计净值 (元) | 资产净值(元) |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|
| 2024-06-30 | 1.0017 | 719,150,945.00 | 1.0017 | 720,438,640.56 |

2.2 净值增长率

| | 起始和截止时间 | 净值增长率 |
|------|----------------------|-------|
| 报告期间 | 2024年6月6日-2024年6月30日 | 0.17% |
| 成立以来 | 2024年6月6日-2024年6月30日 | 0.17% |

注：净值增长率=(期末累计净值-期初累计净值)/期初份额净值*100%；因投资者赎回可能导致在某个时期部分份额为0，该情形下净值增长率的所属区间不连续；年末份额为0时，该年度净值增长率为空；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，投资须谨慎。

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 | 银行存款、同业存单等固定收益类资产 | 0.12% | 100.00% |
| 2 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 3 | 权益类投资 | 0.00% | 0.00% |
| 4 | 金融衍生品 | 0.00% | 0.00% |
| 5 | 代客境外理财投资 QDII | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 商品类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 7 | 另类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 8 | 公募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 9 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 10 | 资产管理产品 | 99.88% | 0.00% |
| 11 | 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 | 720,592,889.82 | 100.00% |
| 2 | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - |
| 6 | - | - | - | - |
| 7 | - | - | - | - |
| 8 | - | - | - | - |
| 9 | - | - | - | - |
| 10 | - | - | - | - |

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 | 485,000,000.00 |

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置现金类、固定收益类资产,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 产品固收类资产持仓风险及价格波动情况

本产品持仓固收类资产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 | 14354101040027243 |

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。