

华夏理财固定收益纯债最短持有7天理财产品C款

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：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2024年4月1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最短持有 7 天理财产品 C 款 |
| 理财产品代码 | 23115012 |
| 产品登记编码 | Z7003923000077 |
| 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 | 111.48% |
| 产品起始日期 | 2023-03-03 |
| 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

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 | 1.0420 | 20,329,515,481.84 | 1.0420 | 21,184,287,339.17 |

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3月31日-2024年6月30日 | 0.75% |
| 成立以来 | 2023年3月3日-2024年6月30日 | 4.20% |
| 2023年 | 2023年3月3日-2023年12月31日 | 2.61% |

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、债券买入返售、债券等固定收益类资产 | 0.02% | 97.01% |
| 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% | 2.99% |
| 9 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 10 | 资产管理产品 | 99.98% | 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 | 1,710,682,629.04 | 7.24% |
| 2 | 农业银行合肥经济技术开发区支行 35 (20240628) | 现金及银行存款 | 539,860,279.59 | 2.29% |
| 3 | 24 南京银行 CD109 | 同业存单 | 352,239,261.00 | 1.49% |
| 4 | 农业银行合肥金寨路支行 20240627-30 | 现金及银行存款 | 329,735,055.01 | 1.40% |
| 5 | 24 中信银行 CD171 | 同业存单 | 275,027,861.57 | 1.16% |
| 6 | 建设银行溧阳嘉丰支行 20231215-35 | 现金及银行存款 | 231,725,539.64 | 0.98% |
| 7 | 24 浦发银行 CD164 | 同业存单 | 231,717,093.00 | 0.98% |
| 8 | 中国银行南京河西支行 20231107-35 | 现金及银行存款 | 189,047,217.89 | 0.80% |
| 9 | 中国银行苏州高新技术产业开发区 支行 20231026-40 | 现金及银行存款 | 181,531,631.05 | 0.77% |
| 10 | 22 中国信达债 01 | 债券 | 165,558,428.27 | 0.70% |

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） |
|----------------|--------------|--------------------|----------------|
| 北京农村商业银行股份有限公司 | 112499652 | 24 北京农商银行 CD133 | 43,789,613.48 |
| 广发银行股份有限公司 | 112420147 | 24 广发银行 CD147 | 79,090,722.96 |
| 广发银行股份有限公司 | 112420149 | 24 广发银行 CD149 | 897,586.37 |
| 广发银行股份有限公司 | 112420155 | 24 广发银行 CD155 | 132,110,345.63 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410118 | 24 兴业银行 CD118 | 44,068,149.27 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410148 | 24 兴业银行 CD148 | 44,014,099.15 |
| 兴业银行股份有限公司 | 242480002 | 24 兴业银行永续债 01 | 9,686,480.27 |
| 兴业银行股份有限公司 | 242480002.IB | 24 兴业银行永续债 01 | 1,300,562.43 |
| 英大泰和财产保险股份有限公司 | 272380010 | 23 英大泰和资本补充债 01 | 5,120,327.14 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 092280083 | 22 建行永续债 01 | 286,859.01 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405162 | 24 建设银行 CD162 | 44,003,620.34 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405194 | 24 建设银行 CD194 | 4,405,186.85 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 2028033 | 20 建设银行二级 | 38,419,468.90 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 232380076 | 23 建行二级资本债 03A | 21,324,343.53 |
| 紫金财产保险股份有限公司 | 272380016 | 23 紫金财险资本补充债 01 | 51,946,688.62 |

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） |
|------------|------------|----------|--------------|
| 首创证券股份有限公司 | 144379.SZ | 庐陵二 4A | 1,199,430.01 |
| 招商证券股份有限公司 | 144183.SZ | 天下 4 优 2 | 722,327.04 |
| 招商证券股份有限公司 | 2489123.IB | 24 海鑫 1B | 482,341.78 |
| 招商证券股份有限公司 | 254452.SH | 24 铜交 D1 | 3,328,849.27 |

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 OTC | 英大资产-活利壹玖 资产管理产品 | 买入 | 100,000,000.00 |
| 中诚信托有 限责任公司 | ZXD32Z2024 01010032472 OTC | 中诚信托-汇鑫 30 号 集合资金信托计划 | 买入 | 10,000,000.00 |
| 中诚信托有 限责任公司 | ZXD32Z2024 01010055251 OTC | 中诚信托-汇鑫 32 号 集合资金信托计划 | 买入 | 99,400,000.00 |

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。本产品以债券等固收类资产为主要投资标的，追求稳健回报。本产品系开放式产品，将根据产品到期或开放时间，做好流动性管理。

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

截止本报告日，债券价格波动处于合理的市场波动区间。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|-------------------|
| 1 | 托管账户 | 10250000003344261 |

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。