

华夏理财固定收益纯债最短持有7天理财产品D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 D 款
理财产品代码	23115013
A 份额销售代码	23115013A
F 份额销售代码	23115013F
M 份额销售代码	23115013M
V 份额销售代码	23115013V
W 份额销售代码	23115013W
Z 份额销售代码	23115013Z
产品登记编码	Z7003923000419
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	101.29%
产品起始日期	2023-09-26
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

2.1 净值和存续规模

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)
2024-06-30	1.0190	4,294,937,321.14	1.0190	4,376,425,213.81

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)
2024-06-30	1.0184	1,487,063,361.35	1.0184	1,514,361,049.00

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)
2024-06-30	1.0226	790,667,737.64	1.0226	808,550,824.09

V 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)
2024-06-30	1.0181	58,101,156.74	1.0181	59,155,691.14

W 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)
2024-06-30	1.0186	178,446,899.22	1.0186	181,774,388.94

Z 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)
2024-06-30	1.0131	49,869,667.63	1.0131	50,520,561.97

2.2 净值增长率

A 份额：

	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	0.69%
成立以来	2023年11月14日-2024年6月30日	1.90%
2023年	2023年11月14日-2023年12月31日	0.44%

F 份额：

	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	0.67%
成立以来	2023年11月14日-2024年6月30日	1.84%
2023年	2023年11月14日-2023年12月31日	0.42%

M 份额：

	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	0.68%
成立以来	2023年9月26日-2024年6月30日	2.26%
2023年	2023年9月26日-2023年12月31日	0.84%

V 份额：

	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	0.66%
成立以来	2023年11月14日-2024年6月30日	1.81%
2023年	2023年11月14日-2023年12月31日	0.42%

W 份额：

	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	0.61%
成立以来	2023年10月27日-2024年6月30日	1.86%
2023年	2023年10月27日-2023年12月31日	0.57%

Z 份额：

	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	0.65%
成立以来	2024年1月8日-2024年6月30日	1.31%

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	现金及银行存款	0.02%	43.83%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.57%
4	债券	0.00%	51.37%
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	1.01%	4.23%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.97%	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	898,799,408.83	12.69%
2	中国银行雄县支行 20240208-30	现金及银行存款	131,129,193.73	1.85%
3	农业银行无锡惠山支行 202403194043	现金及银行存款	100,616,903.57	1.42%
4	农业银行无锡锡山支行 202403197715	现金及银行存款	100,616,903.57	1.42%
5	农业银行射阳县支行 202403228359	现金及银行存款	100,593,520.64	1.42%
6	农业银行合肥经济技术开发区支行 35 (20240628)	现金及银行存款	89,976,713.27	1.27%
7	23 海恒 01	债券	84,792,911.41	1.20%
8	农业银行天津滨海分行 20230906/12	现金及银行存款	83,727,897.68	1.18%
9	农业银行合肥金寨路支行 20240627-30	现金及银行存款	79,935,770.91	1.13%
10	23 皋通 01	债券	79,335,105.35	1.12%

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）
广发银行股份有限公司	112420141	24 广发银行 CD141	3,016,644.35
兴业银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	1,719,718.83
兴业银行股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	664,583.48
中国建设银行股份有限公司	112405123	24 建设银行 CD123	3,152,335.54
中国建设银行股份有限公司	112405126	24 建设银行 CD126	3,812,453.40
中国建设银行股份有限公司	112405146	24 建设银行 CD146	3,810,103.62
中国建设银行股份有限公司	112405154	24 建设银行 CD154	3,809,468.40

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	302,895.13
招商证券股份有限公司	144183.SZ	天下 4 优 2	315,867.27
招商证券股份有限公司	2489123.IB	24 海鑫 1B	210,923.82
招商证券股份有限公司	254452.SH	24 铜交 D1	164,078.00

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	ZXD32Z2023 11010036947 OTC	中诚信托-汇鑫 24 号 集合资金信托计划	买入	100,000,000.00

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系最短持有期产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，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，产品投资的债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益类资产持仓。

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	1025700000946522

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。