

华夏理财固定收益纯债最短持有 180 天理财 产品 A 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 180 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码 | 22115002 |
| A 份额销售代码 | 22115002A |
| B 份额销售代码 | 22115002B |
| M 份额销售代码 | 22115002M |
| N 份额销售代码 | 22115002N |
| S 份额销售代码 | 22115002S |
| Z 份额销售代码 | 22115002Z |
| 产品登记编码 | Z7003922000011 |
| 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 | 113.63% |
| 产品起始日期 | 2022-03-22 |
| 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 | 1.0818 | 1,370,871,809.59 | 1.0818 | 1,483,062,468.39 |

B 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 | 1.0756 | 266,807,721.80 | 1.0756 | 286,985,400.53 |

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 | 1.0694 | 1,286,332,946.65 | 1.0694 | 1,375,617,097.19 |

N 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 | 1.0738 | 40,289,485.12 | 1.0738 | 43,263,258.97 |

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) |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|
| 2024-06-30 | 1.0320 | 759,656,453.35 | 1.0320 | 783,999,475.84 |

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 | 1.0727 | 2,617,472.86 | 1.0727 | 2,807,767.27 |

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 | 0.91% |
| 成立以来 | 2022年3月22日-2024年6月30日 | 8.18% |
| 2023年 | 2023年全年 | 4.82% |
| 2022年 | 2022年3月22日-2022年12月31日 | 1.24% |

B 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 | 0.92% |
| 成立以来 | 2022年4月26日-2024年6月30日 | 7.56% |
| 2023年 | 2023年全年 | 4.82% |
| 2022年 | 2022年4月26日-2022年12月31日 | 0.66% |

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 | 0.92% |
| 成立以来 | 2022年5月31日-2024年6月30日 | 6.94% |
| 2023年 | 2023年全年 | 4.82% |
| 2022年 | 2022年5月31日-2022年12月31日 | 0.08% |

N 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 | 0.97% |
| 成立以来 | 2022年5月31日-2024年6月30日 | 7.38% |
| 2023年 | 2023年全年 | 5.03% |
| 2022年 | 2022年5月31日-2022年12月31日 | 0.19% |

S 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 | 0.96% |
| 成立以来 | 2023年9月28日-2024年6月30日 | 3.20% |
| 2023年 | 2023年9月28日-2023年12月31日 | 1.16% |

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 | 1.32% |
| 成立以来 | 2022 年 7 月 26 日-2024 年 6 月 30 日 | 7.27% |
| 2023 年 | 2023 年全年 | 5.13% |
| 2022 年 | 2022 年 7 月 26 日-2022 年 12 月 31 日 | -0.38% |

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 | 0.05% | 18.29% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 4.37% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.09% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 65.61% |
| 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% | 11.64% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 99.95% | 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 | 275,730,472.30 | 6.10% |
| 2 | 汇添富长添利定期开放债券 A | 公募基金 | 69,402,822.43 | 1.54% |
| 3 | 中银汇享债券 | 公募基金 | 62,264,489.75 | 1.38% |
| 4 | 农业银行天津滨海分行 20230906/12 | 现金及银行存款 | 60,706,890.92 | 1.34% |
| 5 | 24 保利发展 MTN003 | 债券 | 48,648,897.76 | 1.08% |
| 6 | 东方臻裕债券 E | 公募基金 | 46,631,965.52 | 1.03% |
| 7 | 20 民生银行二级 | 债券 | 45,386,244.03 | 1.00% |
| 8 | 中国银行南京河西支行 20231107-35 | 现金及银行存款 | 43,351,092.72 | 0.96% |
| 9 | 农业银行北京门头沟支行 20230908/8 | 现金及银行存款 | 40,465,100.18 | 0.90% |
| 10 | 广发双债添利债券 E | 公募基金 | 38,347,251.31 | 0.85% |

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） |
|--------------|-----------|--------------------|---------------|
| 广发银行股份有限公司 | 112420149 | 24 广发银行 CD149 | 2,660,327.39 |
| 兴业银行股份有限公司 | 232480020 | 24 兴业银行二级资本债 01 | 561,176.86 |
| 兴业银行股份有限公司 | 242480002 | 24 兴业银行永续债 01 | 1,278,400.91 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405126 | 24 建设银行 CD126 | 15,719,183.16 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405146 | 24 建设银行 CD146 | 15,709,494.74 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405149 | 24 建设银行 CD149 | 5,510,770.53 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405154 | 24 建设银行 CD154 | 15,706,875.68 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405185 | 24 建设银行 CD185 | 8,029,746.09 |

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 | 75,468.95 |

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 | 601082 OTC | 英大资产-聚鑫 11 号 资产管理产品 | 买入 | 35,320,000.00 |

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

流动性风险管理方面，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、正逆回购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；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是产品持有有一定比例的高流动性资产，赎回期内主要通过正回购操作或卖出部分资产变现，满足产品的流动性需求。

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，本产品投资的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

截至本报告日，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 | 10257000000881212 |

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。