

华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 1 号

2023 年第 2 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：2023 年 4 月 1 日至 2023 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日日开理财产品 1 号
理财产品代码	21112001
A 份额销售代码	21112001A
D 份额销售代码	21112001D
G 份额销售代码	21112001G
H 份额销售代码	21112001H
产品登记编码	Z7003921000744
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	100.48%
产品起始日期	2022-07-21
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)	期间累计净 值增长率
2023-06-30	1.0240	9,946,460,924.71	1.0240	10,185,239,257.00	0.65%
2023-03-31	1.0174	7,322,981,150.84	1.0174	7,450,744,467.63	

D 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)	期间累计净 值增长率
2023-06-30	1.0241	1,560,921,518.50	1.0241	1,598,522,930.24	0.65%
2023-03-31	1.0175	2,630,111,755.48	1.0175	2,676,196,448.49	

G 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)	期间累计净 值增长率
2023-06-30	1.0225	299,715,578.05	1.0225	306,469,296.67	0.63%
2023-03-31	1.0161	275,446,975.64	1.0161	279,881,594.71	

H 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)	期间累计净 值增长率
2023-06-30	1.0215	7,854,112,284.16	1.0215	8,022,756,999.93	0.65%
2023-03-31	1.0149	4,385,978,601.52	1.0149	4,451,324,624.16	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*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	24.57%	86.01%
2	同业存单	0.00%	3.57%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	8.27%
4	债券	0.00%	0.69%
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%	1.46%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	75.43%	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”类别中包含永续债和优先股。

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	9,067,135,843.12	44.86%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	1,671,655,301.79	8.27%
3	农业银行南通分行 202306290162	现金及银行存款	220,661,008.98	1.09%
4	农业银行南通分行 202306290163	现金及银行存款	220,661,008.98	1.09%
5	农业银行海安市支行 202306299839	现金及银行存款	220,661,008.98	1.09%
6	农业银行海安市支行 202306299840	现金及银行存款	220,661,008.98	1.09%
7	农业银行南通港闸支行 2023062293967	现金及银行存款	220,661,008.98	1.09%
8	农业银行南通港闸支行 2023062293968	现金及银行存款	220,661,008.98	1.09%
9	新华交行定存(2020)8 号	现金及银行存款	143,876,273.71	0.71%
10	建设银行江苏南京 23033101/30 亿	现金及银行存款	118,965,259.55	0.59%

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）
英大保险资产管理有限公司	601082 OTC	英大资产-聚鑫 11 号 保险资管产品	买入	494,600,000.00
英大保险资产管理有限公司	601283 OTC	英大资产-聚鑫 15 号 资产管理产品	买入	214,100,000.00
英大保险资产管理有限公司	YDDC01 OTC	英大资产-聚鑫 8 号 保险资管产品	买入	669,000,000.00
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	170,000,000.00
英大基金管理有限公司	650956 OTC	英大基金-华英稳健 5 号集合资产管理计 划	买入	600,000,000.00

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份份额分红	每万份现金分红
-	-	-

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、债券类资产,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 产品债券持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,债券价格波动处于市场合理区间范围。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,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

截至本报告日,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	10257000000892542

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。