

华夏理财固定收益纯债最短持有 28 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 28 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码 | 23115018 |
| A 份额销售代码 | 23115018A |
| F 份额销售代码 | 23115018F |
| J 份额销售代码 | 23115018J |
| M 份额销售代码 | 23115018M |
| W 份额销售代码 | 23115018W |
| 产品登记编码 | Z7003923000433 |
| 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 | 116.19% |
| 产品起始日期 | 2023-10-13 |
| 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 | 1.0220 | 6,375,849,162.82 | 1.0220 | 6,515,913,597.38 |

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 | 1.0181 | 1,321,401,946.15 | 1.0181 | 1,345,269,856.03 |

J 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 | 1.0182 | 493,632,145.33 | 1.0182 | 502,609,111.74 |

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 | 1.0211 | 206,556,317.09 | 1.0211 | 210,910,720.27 |

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 | 1.0189 | 9,842,228.20 | 1.0189 | 10,028,496.59 |

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 | 0.75% |
| 成立以来 | 2023年10月13日-2024年6月30日 | 2.20% |

| | | |
|--------|-----------------------------------|-------|
| 2023 年 | 2023 年 10 月 13 日-2023 年 12 月 31 日 | 0.67% |
|--------|-----------------------------------|-------|

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 | 0.73% |
| 成立以来 | 2023 年 11 月 21 日-2024 年 6 月 30 日 | 1.81% |
| 2023 年 | 2023 年 11 月 21 日-2023 年 12 月 31 日 | 0.33% |

J 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 | 0.74% |
| 成立以来 | 2023 年 11 月 23 日-2024 年 6 月 30 日 | 1.82% |
| 2023 年 | 2023 年 11 月 23 日-2023 年 12 月 31 日 | 0.32% |

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 | 0.72% |
| 成立以来 | 2023 年 10 月 13 日-2024 年 6 月 30 日 | 2.11% |
| 2023 年 | 2023 年 10 月 13 日-2023 年 12 月 31 日 | 0.62% |

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 | 0.66% |
| 成立以来 | 2023 年 10 月 27 日-2024 年 6 月 30 日 | 1.89% |
| 2023 年 | 2023 年 10 月 27 日-2023 年 12 月 31 日 | 0.51% |

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% | 45.74% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.95% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.00% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 49.77% |
| 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% | 3.54% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 99.98% | 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 | 535,725,151.53 | 5.37% |
| 2 | 建设银行徐州分行 20231207-20 | 现金及银行存款 | 370,741,920.92 | 3.72% |
| 3 | 建设银行南京江宁支行 20231205-20 | 现金及银行存款 | 370,721,800.06 | 3.72% |
| 4 | 建设银行秦淮支行 20231205-20 | 现金及银行存款 | 370,721,800.06 | 3.72% |
| 5 | 建设银行溧阳嘉丰支行 20231215-35 | 现金及银行存款 | 340,368,417.52 | 3.41% |
| 6 | 建设银行沐阳支行 20231208-15.2 | 现金及银行存款 | 281,830,228.97 | 2.83% |
| 7 | 建设银行宝应华夏支行 20231130-10 | 现金及银行存款 | 185,380,408.73 | 1.86% |
| 8 | 建设银行涟水支行 20231208-10 | 现金及银行存款 | 185,354,549.82 | 1.86% |
| 9 | 23 济轨 Y3 | 债券 | 177,538,438.42 | 1.78% |
| 10 | 建设银行泗洪支行 20231208-9 | 现金及银行存款 | 166,873,161.86 | 1.67% |

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 | 297,558.65 |
| 广发银行股份有限公司 | 112420155 | 24 广发银行 CD155 | 897,714.60 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410118 | 24 兴业银行 CD118 | 297,830.76 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410148 | 24 兴业银行 CD148 | 297,465.46 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405122 | 24 建设银行 CD122 | 28,592,431.89 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405162 | 24 建设银行 CD162 | 297,394.64 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 2028033 | 20 建设银行二级 | 381,834.70 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 232380076 | 23 建行二级资本债 03A | 203,322.23 |
| 紫金财产保险股份有限公司 | 272380016 | 23 紫金财险资本补充债 01 | 471,162.93 |

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） |
|------------|------------|----------|------------|
| 招商证券股份有限公司 | 144183.SZ | 天下 4 优 2 | 521,375.17 |
| 招商证券股份有限公司 | 2489123.IB | 24 海鑫 1B | 348,153.97 |

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 | 136,782,874.00 |
| 中诚信托有限责任公司 | ZC1BGI OTC | 中诚信托-汇鑫 19 号 集合资金信托计划 | 买入 | 5,270,000,000.00 |

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

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控。

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

本产品持仓信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生，价格波动可控。

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 | 1025700000947752 |

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。