

华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 1 号

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
K 份额销售代码	21112001K
Z 份额销售代码	21112001Z
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	100.29%
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

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	1.0496	3,136,688,963.17	1.0496	3,292,123,494.40

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)
2024-06-30	1.0496	1,014,003,941.89	1.0496	1,064,296,917.57

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)
2024-06-30	1.0476	424,737,088.23	1.0476	444,944,959.37

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)
2024-06-30	1.0470	1,666,759,729.84	1.0470	1,745,091,848.75

K 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	1.0249	2,137,335,581.91	1.0249	2,190,542,449.35

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	1.0001	500,000,000.00	1.0001	500,033,565.97

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	0.59%
成立以来	2022年7月21日-2024年6月30日	4.96%
2023年	2023年全年	2.55%
2022年	2022年7月21日-2022年12月31日	1.09%

D 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	0.59%
成立以来	2022年7月21日-2024年6月30日	4.96%
2023年	2023年全年	2.56%
2022年	2022年7月21日-2022年12月31日	0.84%

G 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	0.59%
成立以来	2022年7月21日-2024年6月30日	4.76%
2023年	2023年全年	2.53%
2022年	2022年7月21日-2022年12月31日	0.95%

H 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	2022年7月21日-2024年6月30日	4.70%
2023年	2023年全年	2.58%
2022年	2022年7月21日-2022年12月31日	0.82%

K 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	0.60%
成立以来	2023年7月17日-2024年6月30日	2.49%
2023年	2023年7月17日-2023年12月31日	1.23%

Z 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024 年 6 月 28 日-2024 年 6 月 30 日	0.01%
成立以来	2024 年 6 月 28 日-2024 年 6 月 30 日	0.01%

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	0.16%	96.44%
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%	3.56%
9	私募基金	0.00%	0.00%
10	资产管理产品	99.84%	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	1,223,547,177.47	13.21%
2	中国银行南京河西支行 20231107-35	现金及银行存款	849,439,632.21	9.17%
3	中国银行徐州分行 20231107-15	现金及银行存款	364,115,502.06	3.93%
4	农业银行珠海分行 20230927-10	现金及银行存款	243,417,507.03	2.63%
5	建设银行淮安楚州支行 20230927-10	现金及银行存款	243,417,507.03	2.63%
6	建设银行淮安洪泽支行 20230927-10	现金及银行存款	243,417,507.03	2.63%
7	农业银行南海分行 20231024-7.5-3	现金及银行存款	182,057,322.79	1.97%
8	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	179,859,611.09	1.94%
9	农业银行东莞凤岗支行 20231110-15	现金及银行存款	168,547,115.98	1.82%
10	农业银行合肥金寨路支行 20240627-30	现金及银行存款	149,879,570.46	1.62%

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	11,134,642.30
广发银行股份有限公司	112420142	24 广发银行 CD142	1,755,873.41
平安银行股份有限公司	112411069	24 平安银行 CD069	45,436,852.02
平安银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	4,720,134.31
兴业银行股份有限公司	112410050	24 兴业银行 CD050	1,754,099.33
兴业银行股份有限公司	112410101	24 兴业银行 CD101	111,886,297.07
兴业银行股份有限公司	112410122	24 兴业银行 CD122	13,737,050.80
兴业银行股份有限公司	112410135	24 兴业银行 CD135	97,977,435.07
兴业银行股份有限公司	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	494,205.81
中国建设银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	8,272,827.26
中国建设银行股份有限公司	112405123	24 建设银行 CD123	9,773,811.74
中国建设银行股份有限公司	232480006	24 建行二级资本债 01A	11,744,909.06
中国建设银行股份有限公司	242380013	23 建行永续债 01	3,873,595.24

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	249,032.60
招商证券股份有限公司	2489123.IB	24 海鑫 1B	240,681.37

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	170,000,000.00
中诚信托有	ZXD32Z2023	中诚信托-汇鑫 24 号	买入	1,010,000,000.00

限责任公司	11010036947 OTC	集合资金信托计划		
-------	--------------------	----------	--	--

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	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。