

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 200 天理财 产品 B 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 200 天理财产品 B 款
理财产品代码	23115016
A 份额销售代码	23115016A
C 份额销售代码	23115016C
V 份额销售代码	23115016V
产品登记编码	Z7003923000418
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	105.00%
产品起始日期	2023-11-09
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	1.0211	661,194,844.66	1.0211	675,140,984.80

#### C 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	1.0092	614,018,480.98	1.0092	619,668,694.35

#### 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	1.0030	20,000.00	1.0030	20,059.35

### 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	0.78%
成立以来	2023年11月9日-2024年6月30日	2.11%
2023年	2023年11月9日-2023年12月31日	0.50%

#### C 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	0.76%
成立以来	2024年3月12日-2024年6月30日	0.92%

#### V 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年5月27日-2024年6月30日	0.30%

成立以来	2024年5月27日-2024年6月30日	0.30%
------	-----------------------	-------

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	0.52%	10.09%
2	同业存单	0.00%	2.86%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	7.38%
4	债券	0.00%	64.04%
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%	15.63%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.48%	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	137,206,211.38	10.09%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	100,366,240.35	7.38%
3	22 旭辉集团 MTN002	债券	44,228,969.07	3.25%
4	22 碧桂园 MTN001	债券	44,169,147.42	3.25%
5	富安达上清所 0-3 年政金债指数 A	公募基金	41,547,506.56	3.06%
6	23 碧桂园 MTN002	债券	41,516,646.98	3.05%
7	24 陕西机械 MTN001(科创票据)	债券	34,392,643.85	2.53%
8	北信瑞丰稳定收益 A	公募基金	32,836,666.52	2.42%
9	24 海奕控股 PPN001	债券	21,216,474.96	1.56%
10	23 长三角集合 CP001	债券	21,107,457.76	1.55%

### 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）
平安银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	135,647.85
天津中绿电投资股份有限公司	148562	23 绿电 G1	131,528.58
兴业银行股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	436,784.08
中国建设银行股份有限公司	242380013	23 建行永续债 01	291,707.50

#### 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	254452.SH	24 铜交 D1	240,935.07

#### 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	ZC19HA OTC	中诚信托-嘉信 11 号集合资金信托计划	买入	375,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC19KY OTC	中诚信托-汇鑫 11 号集合资金信托计划	买入	10,300,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC1A2W OTC	中诚信托-汇鑫 14 号集合资金信托计划	买入	213,500,000.00
中诚信托有限责任公司	ZXD32Z2023 11010022374 OTC	中诚信托-汇鑫 22 号集合资金信托计划	买入	29,100,000.00



## 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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、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

本产品持仓波动率在合理区间范围内。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,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

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	10257000000948790

## 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。