

华夏理财固定收益纯债型一年定开理财产品 11 号

2024 年半年度报告

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：2024 年 1 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一年定开理财产品 11 号 |
| 理财产品代码 | 22113011 |
| A 份额销售代码 | 22113011A |
| E 份额销售代码 | 22113011E |
| 产品登记编码 | Z7003922000097 |
| 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 | 132.70% |
| 产品起始日期 | 2022-09-23 |
| 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 | 1.0484 | 33,902,125.97 | 1.0484 | 35,543,137.10 |

E 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 | 1.0505 | 7,993,911.00 | 1.0505 | 8,397,683.24 |

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1月1日-2024年6月30日 | 1.52% |
| 成立以来 | 2022年9月23日-2024年6月30日 | 4.84% |
| 2023年 | 2023年全年 | 5.42% |
| 2022年 | 2022年9月23日-2022年12月31日 | -2.04% |

E 份额：

| | 起始和截止时间 | 净值增长率 |
|-------|------------------------|--------|
| 报告期间 | 2024年1月1日-2024年6月30日 | 1.52% |
| 成立以来 | 2022年9月23日-2024年6月30日 | 5.05% |
| 2023年 | 2023年全年 | 5.58% |
| 2022年 | 2022年9月23日-2022年12月31日 | -1.99% |

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 | 2.96% | 2.60% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.00% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 1.04% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 94.24% |
| 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% | 2.12% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 97.04% | 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 | 24 吉利 MTN001(科创票据) | 债券 | 1,951,118.05 | 3.35% |
| 2 | 24 首创集 MTN002 | 债券 | 1,948,178.76 | 3.34% |
| 3 | 存款及清算款等现金类资产 | 现金及银行存款 | 1,513,642.60 | 2.60% |
| 4 | 21 国保 04 | 债券 | 1,477,158.19 | 2.53% |
| 5 | 24 保利 02 | 债券 | 1,472,248.19 | 2.52% |
| 6 | 24 新疆金投 CP001 | 债券 | 1,451,817.86 | 2.49% |
| 7 | 24 鸠江建投 PPN001 | 债券 | 1,093,676.62 | 1.88% |
| 8 | 22 湖口债 | 债券 | 999,936.67 | 1.71% |
| 9 | 21 晋佳 01 | 债券 | 987,700.03 | 1.69% |
| 10 | 24 铜陵建投 PPN001 | 债券 | 976,943.79 | 1.68% |

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） |
|------------|--------|--------|------------|
| 首创证券股份有限公司 | 143930 | 庐陵二 3A | 229,508.43 |

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） |
|-------|------|------|------|---------|
| - | - | - | - | - |

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

本产品持仓债券未出现信用违约等信用风险事件,整体风险可控。

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 | 10250000003306847 |

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。

第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品在投资运作过程中存在违反相关法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。