

华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 12号

2024年第3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：2024年7月1日至2024年9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 12 号
理财产品代码	24112012
E 份额销售代码	24112012E
H 份额销售代码	24112012H
U 份额销售代码	24112012U
产品登记编码	Z7003924000188
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	110.18%
产品起始日期	2024-04-02
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

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)
2024-09-30	1.0140	999,578,713.78	1.0140	1,013,604,893.55

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)
2024-09-30	1.0145	3,133,748,168.01	1.0145	3,179,233,969.62

U 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)
2024-09-30	1.0084	697,227,640.13	1.0084	703,072,926.91

2.2 净值增长率

E 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年6月30日-2024年9月30日	0.70%
成立以来	2024年4月2日-2024年9月30日	1.40%

H 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年6月30日-2024年9月30日	0.72%
成立以来	2024年4月2日-2024年9月30日	1.45%

U 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年6月30日-2024年9月30日	0.72%
成立以来	2024年6月14日-2024年9月30日	0.84%

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	9.80%	99.40%
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%	0.60%
9	私募基金	0.00%	0.00%
10	资产管理产品	90.20%	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	863,530,476.38	16.01%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	281,381,874.69	5.22%
3	建设银行开发区支行 202409125324	现金及银行存款	141,067,707.01	2.62%
4	建设银行开发区支行 202409125325	现金及银行存款	141,061,281.95	2.62%
5	嘉鱼北优	债券	72,546,971.09	1.34%
6	24 阜投 01	债券	70,092,764.32	1.30%
7	21 泰富优	债券	69,653,215.39	1.29%
8	建行溧阳嘉丰支行 20231215	现金及银行存款	67,353,428.00	1.25%
9	23 汉投 07	债券	65,139,160.76	1.21%
10	24 财发 01	债券	52,922,613.10	0.98%

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	242400018	24 北京农商行永续债 01	639,629.70
通威股份有限公司	110085	通 22 转债	151,010.57
兴业银行股份有限公司	232480032	24 兴业银行二级资本债 02	1,759,365.80

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）
国信证券股份有限公司	148829	24 深担 01	1,279,330.79
国信证券股份有限公司	263280	GC 豫电优	2,246,532.57
招商证券股份有限公司	262766	5 美好 1B	545,437.69
招商证券股份有限公司	263289	京诚 126A	13,139,811.64

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	ZC19KY	中诚信托-汇鑫 11 号 集合资金信托计划	买入	143,700,000.00
中诚信托有限责任公司	ZXD32Z2024 0101002600X	中诚信托-汇鑫 29 号 集合资金信托计划	买入	233,500,000.00
中诚信托有限责任公司	ZXD32Z2024 01010032472	中诚信托-汇鑫 30 号 集合资金信托计划	买入	12,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZXD32Z2024 01010055251	中诚信托-汇鑫 32 号 集合资金信托计划	买入	31,800,000.00

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	10257000000970236

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。