

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 14 天理财 产品 D 款

## 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最短持有 14 天理财产品 D 款 |
| 理财产品代码   | 24115012                    |
| A 份额销售代码 | 24115012A                   |
| F 份额销售代码 | 24115012F                   |
| 产品登记编码   | Z7003924000271              |
| 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     | 123.18%                     |
| 产品起始日期   | 2024-05-24                  |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)         | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)         |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|
| 2024-09-30 | 1.0081      | 1,166,280,575.99 | 1.0081      | 1,175,721,939.35 |

#### F 份额:

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)     | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)     |
|------------|-------------|--------------|-------------|--------------|
| 2024-09-30 | 1.0060      | 6,135,949.16 | 1.0060      | 6,172,955.17 |

### 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6月30日-2024年9月30日 | 0.48% |
| 成立以来 | 2024年5月24日-2024年9月30日 | 0.81% |

#### F 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 | 0.44% |
| 成立以来 | 2024年5月24日-2024年9月30日 | 0.60% |

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       | 0.20%     | 20.63%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 78.86%    |
| 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%     | 0.51%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.80%    | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|-------------------|---------|----------------|-------------|
| 1  | 存款及清算款等现金类资产      | 现金及银行存款 | 300,296,113.71 | 20.63%      |
| 2  | 22 首股 04          | 债券      | 21,109,787.10  | 1.45%       |
| 3  | 24 义乌国资 MTN005    | 债券      | 19,604,883.02  | 1.35%       |
| 4  | 22 中国信达债 01       | 债券      | 16,639,906.58  | 1.14%       |
| 5  | 22 津辰 03          | 债券      | 13,719,307.31  | 0.94%       |
| 6  | PR 岛 1A           | 债券      | 12,068,274.58  | 0.83%       |
| 7  | 22 恒信 G4          | 债券      | 11,072,762.44  | 0.76%       |
| 8  | 22 动能 K1          | 债券      | 10,132,805.85  | 0.70%       |
| 9  | 22 广电 01          | 债券      | 10,032,698.41  | 0.69%       |
| 10 | 24 民生租赁货运物流主题债 01 | 债券      | 9,629,658.24   | 0.66%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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 | 7,021.38     |
| 天津中绿电投资股份有限公司  | 148562    | 23 绿电 G1       | 1,620,287.29 |

#### 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） |
|-------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -       |

#### 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 | zcxthx18 | 中诚信托-汇鑫 18 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 875,000,000.00 |

#### 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

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是本产品为短期限最短持有期产品，投资以存款、同业存单、流动性较好的中高信用等级信用债为主，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

### 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

截至本报告日，产品持仓债券价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

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 | 10257000000986746 |

## 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。