

华夏理财固定收益纯债最短持有 28 天理财 产品 A 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 28 天理财产品 A 款
理财产品代码	23115018
A 份额销售代码	23115018A
F 份额销售代码	23115018F
J 份额销售代码	23115018J
M 份额销售代码	23115018M
W 份额销售代码	23115018W
Z 份额销售代码	23115018Z
产品登记编码	Z7003923000433
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	103.30%
产品起始日期	2023-10-13
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)
2024-09-30	1.0289	5,778,239,954.58	1.0289	5,945,037,641.07

F 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	1.0250	1,460,889,223.50	1.0250	1,497,379,162.54

J 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	1.0253	1,474,986,414.22	1.0253	1,512,232,256.64

M 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	1.0281	277,801,080.95	1.0281	285,608,360.67

W 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	1.0252	10,577,462.38	1.0252	10,844,135.67

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)
2024-09-30	1.0027	501,869,169.28	1.0027	503,220,660.25

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	0.68%
成立以来	2023年10月13日-2024年9月30日	2.89%
2023年	2023年10月13日-2023年12月31日	0.67%

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	0.68%
成立以来	2023年11月21日-2024年9月30日	2.50%
2023年	2023年11月21日-2023年12月31日	0.33%

J 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	2023年11月23日-2024年9月30日	2.53%
2023年	2023年11月23日-2023年12月31日	0.32%

M 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	0.69%
成立以来	2023年10月13日-2024年9月30日	2.81%
2023年	2023年10月13日-2023年12月31日	0.62%

W 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	0.62%
成立以来	2023年10月27日-2024年9月30日	2.52%
2023年	2023年10月27日-2023年12月31日	0.51%

Z 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024 年 8 月 22 日-2024 年 9 月 30 日	0.27%
成立以来	2024 年 8 月 22 日-2024 年 9 月 30 日	0.27%

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	3.08%	25.44%
2	同业存单	0.00%	0.40%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.20%
4	债券	0.00%	73.81%
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%	0.16%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	96.92%	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	969,441,188.52	9.62%
2	23 济轨 Y3	债券	233,029,409.24	2.31%
3	建行溧阳嘉丰支行 20231215	现金及银行存款	222,426,532.45	2.21%
4	工鑫 22A	债券	161,192,193.38	1.60%
5	23 北辰 A	债券	139,555,162.51	1.38%
6	GC 曹 06A2	债券	132,348,716.54	1.31%
7	工鑫 23A2	债券	117,027,414.83	1.16%
8	22 华侨城 MTN006	债券	115,220,549.74	1.14%
9	24 青城 05	债券	110,801,556.80	1.10%
10	23 长交 F5	债券	103,343,044.64	1.03%

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)
国信证券股份有限公司	263280	GC 豫电优	5,945,650.21
招商证券股份有限公司	255210	24 北港 D1	984,714.16
招商证券股份有限公司	263089	5 美意 1A	4,339,355.29
招商证券股份有限公司	263090	5 美意 1B	1,171,625.93

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	601082	英大资产-聚鑫 11 号 资产管理产品	买入	2,932,765.53
中诚信托有 限责任公司	ZC1BGI	中诚信托-汇鑫 19 号 集合资金信托计划	买入	3,607,000,000.00

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

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	10257000000947752

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。