

华夏理财固定收益纯债最短持有 30 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 30 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115005
A 份额销售代码	22115005A
B 份额销售代码	22115005B
C 份额销售代码	22115005C
D 份额销售代码	22115005D
H 份额销售代码	22115005H
M 份额销售代码	22115005M
N 份额销售代码	22115005N
O 份额销售代码	22115005O
X 份额销售代码	22115005X
Z 份额销售代码	22115005Z
产品登记编码	Z7003922000025
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	102.86%
产品起始日期	2022-03-22
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	1.0657	219,653,937.84	1.0657	234,089,546.80

B 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	1.0554	3,388,995.95	1.0554	3,576,631.13

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)
2024-09-30	1.0642	45,620,892.92	1.0642	48,549,072.97

D 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	1.0621	563,638,013.68	1.0621	598,638,057.27

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	1.0594	160,226,366.01	1.0594	169,746,385.78

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	1.0643	436,469,987.39	1.0643	464,546,959.53

N 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	1.0371	2,100,241.62	1.0371	2,178,218.66

O 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	1.0517	263,909,930.11	1.0517	277,544,255.01

X 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	1.0612	13,956,513.57	1.0612	14,810,581.34

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	1.0520	689,910.09	1.0520	725,796.21

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	0.53%
成立以来	2022年3月22日-2024年9月30日	6.57%
2023年	2023年全年	2.82%
2022年	2022年3月22日-2022年12月31日	1.83%

B 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	0.53%
成立以来	2022年7月1日-2024年9月30日	5.54%
2023年	2023年全年	2.83%

2022 年	2022 年 7 月 1 日-2022 年 12 月 31 日	0.83%
--------	---------------------------------	-------

C 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	0.57%
成立以来	2022 年 5 月 5 日-2024 年 9 月 30 日	6.42%
2023 年	2023 年全年	2.99%
2022 年	2022 年 5 月 5 日-2022 年 12 月 31 日	1.41%

D 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	0.56%
成立以来	2022 年 5 月 16 日-2024 年 9 月 30 日	6.21%
2023 年	2023 年全年	2.98%
2022 年	2022 年 5 月 16 日-2022 年 12 月 31 日	1.25%

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	0.56%
成立以来	2022 年 6 月 2 日-2024 年 9 月 30 日	5.94%
2023 年	2023 年全年	2.91%
2022 年	2022 年 6 月 2 日-2022 年 12 月 31 日	1.06%

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	0.56%
成立以来	2022 年 5 月 5 日-2024 年 9 月 30 日	6.43%
2023 年	2023 年全年	2.98%
2022 年	2022 年 5 月 5 日-2022 年 12 月 31 日	1.44%

N 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	0.58%

成立以来	2023年5月16日-2024年9月30日	3.71%
2023年	2023年5月16日-2023年12月31日	1.74%

O 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	0.57%
成立以来	2022年12月8日-2024年9月30日	5.17%
2023年	2023年全年	3.04%
2022年	2022年12月8日-2022年12月31日	0.14%

X 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	0.57%
成立以来	2022年6月2日-2024年9月30日	6.12%
2023年	2023年全年	3.03%
2022年	2022年6月2日-2022年12月31日	1.06%

Z 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	0.56%
成立以来	2022年12月7日-2024年9月30日	5.20%
2023年	2023年全年	3.12%
2022年	2022年12月7日-2022年12月31日	0.10%

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	0.04%	65.15%
2	同业存单	0.00%	6.50%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.09%
4	债券	0.00%	24.94%
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%	1.31%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.96%	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	中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026	现金及银行存款	187,855,525.59	10.07%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	138,584,618.24	7.43%
3	农行台州温岭支行 20	现金及银行存款	51,436,492.72	2.76%
4	工行中山银苑支行 9.9	现金及银行存款	50,720,570.40	2.72%
5	建行连云港分行 20230829-1	现金及银行存款	47,083,328.38	2.52%
6	建行连云港分行 20230829-2	现金及银行存款	47,083,328.38	2.52%
7	建行连云港分行 20230829-3	现金及银行存款	47,083,328.38	2.52%
8	建行连云港分行 20230829-4	现金及银行存款	47,083,328.38	2.52%
9	中行常熟分行 20231024	现金及银行存款	46,971,371.01	2.52%
10	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	39,090,919.31	2.09%

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	1,056,770.35

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）
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	4,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC1A34	中诚信托-汇鑫 15 号 集合资金信托计划	买入	494,000,000.00

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,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

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,整体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

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	10257000000881063

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。