

华夏理财固定收益纯债最短持有 60 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 60 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115006
A 份额销售代码	22115006A
B 份额销售代码	22115006B
C 份额销售代码	22115006C
E 份额销售代码	22115006E
M 份额销售代码	22115006M
N 份额销售代码	22115006N
Z 份额销售代码	22115006Z
产品登记编码	Z7003922000026
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	100.04%
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	1.0678	539,921,850.40	1.0678	576,510,103.50

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	1.0545	13,175,669.10	1.0545	13,893,726.80

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	1.0595	824,608,803.04	1.0595	873,709,926.93

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	1.0716	39,335,635.08	1.0716	42,153,188.62

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	1.0555	139,736,835.63	1.0555	147,498,681.34

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	1.0605	6,189,805.12	1.0605	6,564,356.50

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	1.0128	795,861,740.38	1.0128	806,045,556.48

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	0.54%
成立以来	2022年3月22日-2024年9月30日	6.78%
2023年	2023年全年	3.74%
2022年	2022年3月22日-2022年12月31日	1.18%

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	5.45%
2023年	2023年全年	3.73%
2022年	2022年7月1日-2022年12月31日	-0.08%

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	0.56%
成立以来	2022年6月15日-2024年9月30日	5.95%
2023年	2023年全年	3.89%
2022年	2022年6月15日-2022年12月31日	0.13%

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	0.55%
成立以来	2022年9月9日-2024年9月30日	4.93%
2023年	2023年全年	3.95%
2022年	2022年9月9日-2022年12月31日	-0.87%

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	0.52%
成立以来	2022年5月31日-2024年9月30日	5.55%
2023年	2023年全年	3.74%
2022年	2022年5月31日-2022年12月31日	0.02%

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	2022年5月31日-2024年9月30日	6.05%
2023年	2023年全年	3.94%
2022年	2022年5月31日-2022年12月31日	0.13%

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	0.62%
成立以来	2024年3月29日-2024年9月30日	1.28%

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	12.56%	100.00%
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%	0.00%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	87.44%	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	379,382,768.02	15.38%
2	中行南京河西支行 20231107	现金及银行存款	206,602,382.53	8.37%
3	中行雄县支行 20240208	现金及银行存款	206,376,112.28	8.36%
4	中行徐州分行 20231107	现金及银行存款	88,567,516.75	3.59%
5	中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026	现金及银行存款	54,520,135.97	2.21%
6	农业银行清新领秀支行 202307207364	现金及银行存款	49,042,298.27	1.99%
7	农业银行清新领秀支行 202307207366	现金及银行存款	49,042,298.27	1.99%
8	农业银行南通分行 202306290162	现金及银行存款	49,033,369.68	1.99%
9	农业银行南通分行 202306290163	现金及银行存款	49,033,369.68	1.99%
10	农业银行海安市支行 202306299839	现金及银行存款	49,033,369.68	1.99%

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)
-	-	-	-

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	ZC19HA	中诚信托-嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	500,000,000.00
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	305,000,000.00

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

截至本报告日,无权益持仓。

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	10257000000881074

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。