

华夏理财固定收益纯债最短持有 90 天理财 产品 B 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：招商银行股份有限公司

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 90 天理财产品 B 款
理财产品代码	22115009
A 份额销售代码	22115009A
F 份额销售代码	22115009F
S 份额销售代码	22115009S
产品登记编码	Z7003922000074
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	100.02%
产品起始日期	2022-07-07
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	1.0622	13,298,810.92	1.0622	14,126,629.78

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	1.0139	521,538,721.73	1.0139	528,802,721.83

S 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	1.0646	5,124,354,174.22	1.0646	5,455,177,096.50

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	0.60%
成立以来	2022年7月7日-2024年9月30日	6.22%
2023年	2023年全年	2.88%
2022年	2022年7月7日-2022年12月31日	0.91%

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	0.59%
成立以来	2024年3月7日-2024年9月30日	1.39%

S 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	0.63%
成立以来	2022年7月7日-2024年9月30日	6.46%
2023年	2023年全年	2.95%
2022年	2022年7月7日-2022年12月31日	1.38%

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	6.22%	93.02%
2	同业存单	0.00%	1.64%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	5.34%
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	93.78%	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	750,856,937.29	12.52%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	649,628,759.13	10.83%
3	农行天津滨海分行定期存款	现金及银行存款	494,590,550.56	8.24%
4	中行雄县支行 20240208	现金及银行存款	448,010,390.18	7.47%
5	农行北京门头沟支行定期存款	现金及银行存款	329,677,063.75	5.50%
6	农行合肥金寨路支行 20240627	现金及银行存款	292,414,510.30	4.87%
7	建行连云港分行 20230829-1	现金及银行存款	188,191,662.88	3.14%
8	建行连云港分行 20230829-2	现金及银行存款	188,191,662.88	3.14%
9	建行连云港分行 20230829-3	现金及银行存款	188,191,662.88	3.14%
10	建行连云港分行 20230829-4	现金及银行存款	188,191,662.88	3.14%

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）
-	-	-	-	-

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

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,提前储备流动性资金;二是根据当前市场收益率情况及对未来市场趋势的研判,合理制定组合加权久期,防范流动性风险;三是择机通过债券正回购、债券卖出、基金赎回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

截止本报告日,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	110945467910303

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。