

# 华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 9 号

## 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型日日开理财产品 9 号 |
| 理财产品代码   | 24112009               |
| A 份额销售代码 | 24112009A              |
| 产品登记编码   | Z7003924000023         |
| 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     | 100.92%                |
| 产品起始日期   | 2024-01-22             |
| 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

| 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 | 1.0182      | 7,123,378,216.09 | 1.0182      | 7,253,061,456.22 |

### 2.2 净值增长率

|      | 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 | 2024年1月22日-2024年9月30日 | 1.82% |

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       | 4.92%     | 77.23%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 2.33%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 2.18%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 15.71%    |
| 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%     | 2.54%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 95.08%    | 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         | 889,529,180.16 | 12.15%      |
| 2  | 建设银行开发区支行 202409125324 | 现金及银行存款         | 184,114,315.69 | 2.52%       |
| 3  | 建设银行开发区支行 202409125325 | 现金及银行存款         | 184,105,930.03 | 2.52%       |
| 4  | 定期存款                   | 现金及银行存款         | 177,023,612.26 | 2.42%       |
| 5  | 债券买入返售                 | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 159,896,761.83 | 2.18%       |
| 6  | 建行张家界桑植支行 20230824     | 现金及银行存款         | 146,546,541.40 | 2.00%       |
| 7  | 建行邵阳城南支行 20230824      | 现金及银行存款         | 146,546,541.40 | 2.00%       |
| 8  | 中行雄县支行 20240208        | 现金及银行存款         | 130,582,554.23 | 1.78%       |
| 9  | 农行台州温岭支行 20            | 现金及银行存款         | 120,571,648.42 | 1.65%       |
| 10 | 工行中山银苑支行 9.9           | 现金及银行存款         | 118,893,463.75 | 1.62%       |

### 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 | 153,554.87   |
| 广发银行股份有限公司     | 1928031   | 19 广发银行永续债     | 2,142,958.29 |

#### 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）      |
|------------|--------|---------|--------------|
| 国信证券股份有限公司 | 263280 | GC 豫电优  | 2,287,585.16 |
| 招商证券股份有限公司 | 263289 | 京诚 126A | 9,275,298.78 |

#### 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 | ZC19KY                    | 中诚信托-汇鑫 11 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 198,020,000.00 |
| 中诚信托有限责任公司 | ZXD32Z2023<br>11010022374 | 中诚信托-汇鑫 22 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 395,000,000.00 |

#### 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 | 10257000000964018 |

## 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。