

华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 11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 11 号
理财产品代码	24112011
A 份额销售代码	24112011A
F 份额销售代码	24112011F
产品登记编码	Z7003924000177
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	102.48%
产品起始日期	2024-03-12
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	1.0181	11,937,774,952.70	1.0181	12,153,809,697.07

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	1.0042	1,245,749,333.96	1.0042	1,250,921,635.58

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	0.81%
成立以来	2024年3月12日-2024年9月30日	1.81%

F 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年8月2日-2024年9月30日	0.42%
成立以来	2024年8月2日-2024年9月30日	0.42%

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	4.06%	16.64%
2	同业存单	0.00%	0.92%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	4.54%
4	债券	0.00%	77.31%
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%	0.58%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	95.94%	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	1,569,097,628.52	11.42%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	624,220,171.65	4.54%
3	漳州 010A	债券	260,855,273.76	1.90%
4	24 东航 SCP007	债券	221,047,315.80	1.61%
5	农业银行合肥经济技术开发区支行 35	现金及银行存款	200,431,656.47	1.46%
6	22 国开 20	债券	189,684,763.76	1.38%
7	24 明德 EB	债券	176,823,012.78	1.29%
8	24 一汽租赁 MTN001	债券	152,421,903.30	1.11%
9	22 中电投 MTN024	债券	136,633,839.05	0.99%
10	23 国开 10	债券	134,095,662.36	0.98%

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	24,217,476.76
兴业银行股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	76,378,571.76
中国建设银行股份有限公司	112405262	24 建设银行 CD262	54,579,842.12
中国建设银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	68,261,362.16
中国建设银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	53,661,251.53

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	148829	24 深担 01	8,582,303.70
招商证券股份有限公司	263089	5 美意 1A	1,889,969.07
招商证券股份有限公司	263090	5 美意 1B	510,291.65

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 号集合资金信托计划	买入	1,354,907,140.00
中诚信托有限责任公司	ZXD32Z2023 11010022356	中诚信托-汇鑫 21 号集合资金信托计划	买入	9,699,000,000.00

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

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	10257000000968217

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。