

# 华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 13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 13 号
理财产品代码	24112013
A 份额销售代码	24112013A
产品登记编码	Z7003924000191
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	103.02%
产品起始日期	2024-03-25
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 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)
2024-09-30	1.01693	8,704,656,722.70	1.01693	8,852,021,019.47

### 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	0.76%
成立以来	2024年3月25日-2024年9月30日	1.69%

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	8.36%	27.80%
2	同业存单	0.00%	1.07%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	6.23%
4	债券	0.00%	62.18%
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%	2.72%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	91.64%	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	865,444,197.99	9.49%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	568,347,794.96	6.23%
3	中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026	现金及银行存款	262,972,065.99	2.88%
4	建行张家界桑植支行 20230824	现金及银行存款	110,542,576.61	1.21%
5	建行邵阳城南支行 20230824	现金及银行存款	110,542,576.61	1.21%
6	建行常德武陵支行 20230824	现金及银行存款	73,695,050.92	0.81%
7	建行湘西吉首支行 20230824	现金及银行存款	73,695,050.92	0.81%
8	建行连云港分行 20230829-1	现金及银行存款	65,910,225.94	0.72%
9	建行连云港分行 20230829-2	现金及银行存款	65,910,225.94	0.72%
10	建行连云港分行 20230829-3	现金及银行存款	65,910,225.94	0.72%

### 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	5,115,045.03
广发银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	2,133,529.60

#### 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	1,962,931.74
国信证券股份有限公司	263280	GC 豫电优	4,456,405.80
招商证券股份有限公司	263289	京诚 126A	22,805,575.22

#### 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	362,500,000.00
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	881,820,000.00
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	632,200,000.00
中诚信托有限责任公司	ZXD32Z2023 11010022374	中诚信托-汇鑫 22 号 集合资金信托计划	买入	1,875,000,000.00

#### 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	10257000000969811

## 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。