

华夏理财固定收益纯债型一年定开理财产品 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一年定开理财产品 11 号 |
| 理财产品代码 | 22113011 |
| A 份额销售代码 | 22113011A |
| E 份额销售代码 | 22113011E |
| 产品登记编码 | Z7003922000097 |
| 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 | 123.90% |
| 产品起始日期 | 2022-09-23 |
| 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 | 1.0578 | 18,727,868.18 | 1.0578 | 19,810,250.44 |

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 | 1.0599 | 4,833,164.00 | 1.0599 | 5,122,838.94 |

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 | 0.90% |
| 成立以来 | 2022年9月23日-2024年9月30日 | 5.78% |
| 2023年 | 2023年全年 | 5.42% |
| 2022年 | 2022年9月23日-2022年12月31日 | -2.04% |

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 | 0.89% |
| 成立以来 | 2022年9月23日-2024年9月30日 | 5.99% |
| 2023年 | 2023年全年 | 5.58% |
| 2022年 | 2022年9月23日-2022年12月31日 | -1.99% |

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 | 0.13% | 1.07% |
| 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% | 98.78% |
| 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% | 0.15% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 99.87% | 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 | 24 吉利 MTN001(科创票据) | 债券 | 1,126,405.94 | 3.65% |
| 2 | 24 首创集 MTN002 | 债券 | 1,123,183.63 | 3.64% |
| 3 | 24 晋能煤业 MTN009 | 债券 | 914,522.09 | 2.96% |
| 4 | 24 保利 02 | 债券 | 846,369.09 | 2.74% |
| 5 | 24 新疆金投 CP001 | 债券 | 838,558.44 | 2.71% |
| 6 | 24 鸠江建投 PPN001 | 债券 | 629,453.62 | 2.04% |
| 7 | 22 湖口债 | 债券 | 579,483.31 | 1.88% |
| 8 | 21 晋佳 01 | 债券 | 569,401.11 | 1.84% |
| 9 | 24 铜陵建投 PPN001 | 债券 | 561,963.07 | 1.82% |
| 10 | 22 兴投 04 | 债券 | 559,581.08 | 1.81% |

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） |
|------------|-----------|--------------------|------------|
| 通威股份有限公司 | 110085 | 通 22 转债 | 314,269.43 |
| 兴业银行股份有限公司 | 232480032 | 24 兴业银行二级资本债 02 | 159,503.04 |

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

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

本产品持仓债券未出现信用违约等信用风险事件,整体风险可控。

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 | 10250000003306847 |

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。