

华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 E 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：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最短持有 7 天理财产品 E 款 |
| 理财产品代码 | 23115017 |
| 产品登记编码 | Z7003923000422 |
| 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 | 106.58% |
| 产品起始日期 | 2023-11-14 |
| 产品终止日期 | 无特定存续期限 |

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 | 1.0289 | 17,334,800,065.15 | 1.0289 | 17,835,215,325.01 |

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 | 2023年11月14日-2024年9月30日 | 2.89% |
| 2023年 | 2023年11月14日-2023年12月31日 | 0.48% |

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 | 银行存款、债券买入返售、债券等固定收益类资产 | 9.30% | 96.62% |
| 2 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 3 | 权益类投资 | 0.00% | 0.00% |
| 4 | 金融衍生品 | 0.00% | 0.00% |
| 5 | 代客境外理财投资 QDII | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 商品类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 7 | 另类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 8 | 公募基金 | 2.80% | 3.38% |
| 9 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 10 | 资产管理产品 | 87.90% | 0.00% |
| 11 | 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 | 2,478,655,946.39 | 13.04% |
| 2 | 债券买入返售 | 拆放同业及债券 买入返售 | 2,398,137,867.33 | 12.62% |
| 3 | 前海开源货币 B | 公募基金 | 300,052,886.93 | 1.58% |
| 4 | 建设银行开发区支行 202409125324 | 现金及银行存款 | 208,113,477.67 | 1.09% |
| 5 | 建设银行开发区支行 202409125325 | 现金及银行存款 | 208,103,998.95 | 1.09% |
| 6 | 中信保诚货币 B | 公募基金 | 200,030,863.58 | 1.05% |
| 7 | 建行溧阳嘉丰支行 20231215 | 现金及银行存款 | 167,466,675.56 | 0.88% |
| 8 | 中行雄县支行 20240208 | 现金及银行存款 | 165,168,438.86 | 0.87% |
| 9 | 24 青岛农商行 CD153 | 同业存单 | 134,374,705.50 | 0.71% |
| 10 | 农行合肥金寨路支行 20240627 | 现金及银行存款 | 130,717,620.56 | 0.69% |

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 | 112483434 | 24 北京农商银行 CD166 | 34,707,307.60 |
| 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 | 3,359,918.58 |
| 广发银行股份有限公司 | 242400011 | 24 广发银行永续债 01 | 28,351.16 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 232480033 | 24 建行二级资本债 02A | 56,303.27 |

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) |
|------------|--------|---------|------------|
| 招商证券股份有限公司 | 262766 | 5 美好 1B | 343,855.53 |
| 招商证券股份有限公司 | 263089 | 5 美意 1A | 101,767.07 |
| 招商证券股份有限公司 | 263090 | 5 美意 1B | 27,477.11 |

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 | ZXD32Z2024 01010032472 | 中诚信托-汇鑫 30 号 集合资金信托计划 | 买入 | 15,000,000.00 |
| 中诚信托有限责任公司 | ZXD32Z2024 01010055251 | 中诚信托-汇鑫 32 号 集合资金信托计划 | 买入 | 16,000,000.00 |

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

流动性风险控制方面, 本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。本产品以债券等固收类资产为主要投资标的, 追求稳健回报。本产品系开放式产品, 将根据产品到期或开放时间, 做好流动性管理。

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, 债券价格波动处于合理的市场波动区间。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日, 本产品无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日, 本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|-------------------|
| 1 | 托管账户 | 10257000000948778 |

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。