

华夏理财固定收益纯债型半年定开理财产品 1 号

2024 年第 4 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 10 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益纯债型半年定开理财产品 1 号
理财产品代码	21113201
A 份额销售代码	21113201A
B 份额销售代码	21113201B
产品登记编码	Z7003921000461
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	119.36%
产品起始日期	2021-11-23
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)
2024-12-31	1.0919	54,042,408.03	1.0919	59,007,721.10

B 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)
2024-12-31	1.0949	18,099,888.10	1.0949	19,817,910.26

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09月30日-2024年12月31日	0.75%
成立以来	2021年11月23日-2024年12月31日	9.19%
2023年	2023年全年	4.27%
2022年	2022年全年	1.68%
2021年	2021年11月23日-2021年12月31日	0.51%

B 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.76%
成立以来	2021年11月23日-2024年12月31日	9.49%
2023年	2023年全年	4.37%
2022年	2022年全年	1.76%
2021年	2021年11月23日-2021年12月31日	0.51%

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	0.77%	5.13%
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	5.23%	94.75%
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%	0.12%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	94.00%	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	4,828,438.20	5.13%
2	24 商城 Y1	债券	4,173,585.93	4.44%
3	20 济宁城投永续期债	债券	2,919,118.96	3.10%
4	23 中交 01	债券	1,772,431.89	1.88%
5	24 兴化国投 PPN001(资产担保)	债券	1,757,297.31	1.87%
6	24 中电投 MTN007B	债券	1,254,054.36	1.33%
7	24 民生银行永续债 01	债券	1,251,807.84	1.33%
8	23 洛阳城乡 PPN007	债券	1,237,743.15	1.32%
9	河钢 YK01	债券	1,233,244.76	1.31%
10	21 青岛财富 PPN001	债券	1,158,675.95	1.23%

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）
-	-	-	-

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	242480070	24 招行永续债 01BC	289,129.86

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

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；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，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出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

截至本报告日，产品投资的债券资产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	10257000000857018

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。