

# 华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 11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
Z 份额销售代码	24112011Z
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	100.93%
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)
2024-12-31	1.0248	8,674,540,513.66	1.0248	8,889,688,164.99

#### 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)
2024-12-31	1.0106	2,345,608,501.32	1.0106	2,370,581,506.33

#### Z 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	1.0098	79,243,231.08	1.0098	80,019,310.71

### 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	0.66%
成立以来	2024年03月12日-2024年12月31日	2.48%

#### F 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	0.64%
成立以来	2024年08月02日-2024年12月31日	1.06%

#### Z 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年10月09日-2024年12月31日	0.65%
成立以来	2024年08月08日-2024年12月31日	0.98%

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	0.02%	30.09%
2	同业存单	0.00%	1.01%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	6.82%
4	债券	0.00%	56.49%
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%	5.59%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.98%	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	1,546,326,544.43	13.51%
2	拆放同业及债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	780,566,399.71	6.82%
3	农业银行合肥经济技术 35 (20240628)	现金及银行存款	322,637,163.36	2.82%
4	漳州 010A	债券	209,653,368.22	1.83%
5	农行合肥 20240627	现金及银行存款	200,430,319.39	1.75%
6	22 和闽优	债券	147,269,216.78	1.29%
7	浙商银行深圳分行 01	现金及银行存款	127,604,840.62	1.11%
8	浙商银行深圳分行 02	现金及银行存款	127,604,840.62	1.11%
9	中信百信银行 20241220	现金及银行存款	126,638,650.62	1.11%
10	22 中电投 MTN024	债券	109,942,315.49	0.96%

### 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)
北京京投投资有限公司	263831	24 京投优	3,353,130.35
国网国际融资租赁有限公司	042483413	24 国网租赁 CP004	45,736,540.61
中国建设银行股份有限公司	112405232	24 建设银行 CD232	85,510,115.69

#### 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	144789	24 国电投海南绿色 ABS 优	2,471,801.93
开源证券股份有限公司	082482249	24 浙海宗正 ABN002 优先	11,672,116.45
首创证券股份有限公司	144934	宝元 01 优	6,089,158.68
招商证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	63.52
招商证券股份有限公司	263758	予鑫 5A	5,806,692.68
招商证券股份有限公司	263759	予鑫 5B	658,091.84
招商证券股份有限公司	263827	予鑫 6A	2,125,034.61
招商证券股份有限公司	264061	予鑫 8A	2,754,619.40

#### 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	ZXD32Z2023 11010022356	中诚信托-汇鑫 21 号	买入	208,000,000.00



#### 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。