

华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 C 款

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最短持有 7 天理财产品 C 款
理财产品代码	23115012
产品登记编码	Z7003923000077
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	PR1 级（低风险）
杠杆水平	110.70%
产品起始日期	2023-03-03
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)
2024-12-31	1.0550	8,644,219,153.19	1.0550	9,119,337,377.47

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09月30日-2024年12月31日	0.55%
成立以来	2023年03月03日-2024年12月31日	5.50%
2023年	2023年03月03日-2023年12月31日	2.61%

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	6.91%	97.15%
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	0.00%	2.85%
9	私募基金	0.00%	0.00%
10	资产管理产品	93.09%	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	拆放同业及债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	1,631,958,152.52	16.17%
2	农业银行合肥经济技术 35 (20240628)	现金及银行存款	437,321,433.86	4.33%
3	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	353,768,157.88	3.50%
4	农行合肥 20240627	现金及银行存款	333,760,217.47	3.31%
5	中行苏州高新技术产业 20231026	现金及银行存款	184,212,266.59	1.82%
6	中行定期存款 20240208	现金及银行存款	166,410,661.15	1.65%
7	建行徐州分行 20231207	现金及银行存款	164,540,137.45	1.63%
8	中行扬州分行 20231031	现金及银行存款	158,886,634.28	1.57%
9	建行 20231130	现金及银行存款	82,267,325.33	0.81%
10	建行定期存款 20231208	现金及银行存款	82,262,858.13	0.81%

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)
-	-	-	-

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)
开源证券股份有限公司	082482249	24 浙海宗正 ABN002 优 先	7,777,186.86
首创证券股份有限公司	144725	24 橙融 2A	2,194,442.55
招商证券股份有限公司	134092	24 穗开 Y6	1,256,765.08
招商证券股份有限公司	263439	予鑫 3B	39,692.42

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。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	10250000003344261

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。