

华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 F 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 F 款
理财产品代码	24115001
A 份额销售代码	24115001A
产品登记编码	Z7003924000021
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	100.32%
产品起始日期	2024-03-20
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

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	1.0243	3,540,313,969.81	1.0243	3,626,324,365.43

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	0.67%
成立以来	2024年03月20日-2024年12月31日	2.43%

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	35.40%	100.00%
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%	0.00%
9	私募基金	0.00%	0.00%
10	资产管理产品	64.60%	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	2,260,252,909.26	62.13%
2	拆放同业及债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	519,591,372.62	14.28%
3	建设银行 202409125324	现金及银行存款	120,549,846.09	3.31%
4	建设银行 202409125325	现金及银行存款	120,517,898.43	3.31%
5	中行扬州分行 20231031	现金及银行存款	99,323,162.25	2.73%
6	农业银行合肥经济技术 35 (20240628)	现金及银行存款	63,623,593.67	1.75%
7	建行 20230921	现金及银行存款	49,673,254.58	1.37%
8	建行 20230921	现金及银行存款	49,673,254.58	1.37%
9	建行 20230921	现金及银行存款	49,673,254.58	1.37%
10	建行 20230920	现金及银行存款	49,609,155.79	1.36%

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)
兴业银行股份有限公司	113052	兴业转债	701,983.01

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	9,953.89
开源证券股份有限公司	082482249	24 浙海宗正 ABN002 优 先	1,611,652.21
首创证券股份有限公司	144725	24 橙融 2A	1,727,282.28
首创证券股份有限公司	144934	宝元 01 优	138,068.01
招商证券股份有限公司	144710	荟享 18 号第 5 期优先 A 级(第 1 期次)	1,226,988.46
招商证券股份有限公司	144711	荟享 18 号第 5 期优先 B 级(第 1 期次)	84,945.36
招商证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	4,205,242.26
招商证券股份有限公司	263576	予鑫 4A	314,358.46
招商证券股份有限公司	263577	予鑫 4B	37,723.02

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	ZC19KY	中诚信托-汇鑫 11 号	买入	56,230,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2024 01010032472	中诚信托-汇鑫 30 号	买入	80,300,000.00

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

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	10257000000968863

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。