

华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 I 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 I 款
理财产品代码	24115019
A 份额销售代码	24115019A
B 份额销售代码	24115019B
U 份额销售代码	24115019U
产品登记编码	Z7003924000342
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	111.80%
产品起始日期	2024-07-23
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	1.0166	912,940,862.26	1.0166	928,126,367.14

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	1.0041	39,657,519.59	1.0041	39,822,020.48

U 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	1.0090	1,106,851,428.36	1.0090	1,116,831,689.64

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	0.86%
成立以来	2024年07月23日-2024年12月31日	1.66%

B 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年11月15日-2024年12月31日	0.41%
成立以来	2024年11月15日-2024年12月31日	0.41%

U 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	0.88%
成立以来	2024年09月27日-2024年12月31日	0.90%

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	0.45%	15.53%
2	同业存单	0.00%	3.02%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	13.47%
4	债券	0.00%	53.71%
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	9.60%	14.27%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	89.95%	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	拆放同业及债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	313,985,357.18	13.47%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	311,851,514.91	13.38%
3	交银天利宝货币 E	公募基金	100,052,466.80	4.29%
4	前海开源货币 B	公募基金	100,038,014.67	4.29%
5	24 长集 03	债券	59,608,432.86	2.56%
6	24 武投 01	债券	38,024,821.41	1.63%
7	24 晋投 D1	债券	37,586,284.47	1.61%
8	24 港城 Y1	债券	28,542,202.30	1.22%
9	中信百信银行 20241220	现金及银行存款	25,006,834.78	1.07%
10	24 宁资 01	债券	23,116,817.81	0.99%

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	218,783.80
首创证券股份有限公司	144934	宝元 01 优	2,639,988.24
首创证券股份有限公司	256469	24 雨山 01	251,955.88
招商证券股份有限公司	134092	24 穗开 Y6	3,059,464.25

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	买入	10,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2024 08010070267	中诚信托-汇鑫 56 号	买入	23,300,000.00

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,合理配置现金类、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

截至本报告日,债券价格波动处于市场合理区间范围。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,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

截至本报告日,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	10257000000995717

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。