

# 华夏理财固收纯债臻享封闭私募理财产品 23号

## 2024年第3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7月1日至2024年9月30日

## 第一章 基本信息

|         |                         |
|---------|-------------------------|
| 产品名称    | 华夏理财固收纯债臻享封闭私募理财产品 23 号 |
| 理财产品代码  | 24711003                |
| 产品登记编码  | Z7003924A000030         |
| 产品募集方式  | 私募                      |
| 产品运作模式  | 封闭式                     |
| 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    | 117.89%                 |
| 产品起始日期  | 2024-03-20              |
| 产品终止日期  | 2025-04-16              |

## 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<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|
| 2024-09-30 | 1.0199      | 200,000,000.00 | 1.0199      | 203,997,725.66 |

### 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6月30日-2024年9月30日 | 1.11% |
| 成立以来 | 2024年3月20日-2024年9月30日 | 1.99% |

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       | 0.04%     | 2.55%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 1.98%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 95.47%    |
| 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%     | 0.00%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.96%    | 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<br>(元)  | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------|---------|--------------|-------------|
| 1  | 24 湘高速 MTN003  | 债券      | 7,371,333.22 | 3.07%       |
| 2  | 存款及清算款等现金类资产   | 现金及银行存款 | 6,128,084.73 | 2.55%       |
| 3  | 22 余杭创新 PPN003 | 债券      | 5,359,482.81 | 2.23%       |
| 4  | 19 长交 01       | 债券      | 4,999,195.24 | 2.08%       |
| 5  | 23 昆山高新 MTN001 | 债券      | 4,972,863.52 | 2.07%       |
| 6  | 23 平证 07       | 债券      | 4,972,707.98 | 2.07%       |
| 7  | 24 国开 10       | 债券      | 4,928,984.59 | 2.05%       |
| 8  | 24TCLK1        | 债券      | 4,928,402.83 | 2.05%       |
| 9  | 24 湘高速 MTN006  | 债券      | 4,829,944.33 | 2.01%       |
| 10 | 24 民生银行 CD288  | 同业存单    | 4,764,838.67 | 1.98%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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） |
|-------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -       |

#### 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

由于本产品为封闭式产品，故投资组合流动性风险较低，将根据产品的到期时间，做好流动性管理和变现安排。

### 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 | 10257000000969323 |

## 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。