

华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 24 号

2022 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：2022 年 08 月 23 日至 2022 年 09 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 24 号
理财产品代码	21111024
A 份额销售代码	21111024A
B 份额销售代码	21111024B
产品登记编码	Z7003921000623
产品募集方式	公募
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	110.77%
产品起始日期	2022-08-23
产品终止日期	2023-01-10

第二章 净值、存续规模及收益表现

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)	期间累计净 值增长率
2022-09-30	1.0021	355,209,605.00	1.0021	355,960,800.65	0.21%
2022-08-23	1.0000	-	1.0000	-	

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)	期间累计净 值增长率
2022-09-30	1.0022	170,977,922.00	1.0022	171,357,343.31	0.22%
2022-08-23	1.0000	-	1.0000	-	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*100%

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	1.52%	1.74%
2	同业存单	0.00%	7.05%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.92%
4	债券	0.00%	80.05%
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	4.84%	9.24%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	93.64%	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。

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	21 国新 03	债券	13,214,608.30	2.26%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	11,235,403.57	1.92%
3	诺安优化收益债券	公募基金	10,937,427.76	1.87%
4	20 济城 G1	债券	10,792,618.38	1.85%
5	现金及银行存款	现金及银行存款	10,167,305.96	1.74%
6	21 付息国债 05	债券	9,664,422.37	1.65%
7	易方达 7-10 年国开行 A	公募基金	9,170,991.87	1.57%
8	20 益阳交投 MTN001	债券	8,055,888.10	1.38%
9	20 民生银行二级	债券	7,853,174.30	1.34%
10	华夏可转债增强 C	公募基金	7,808,767.44	1.34%

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	买入规模（元）
鲁能集团有限公司	137819.SH	22 鲁能 02	46,454.40

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	买入规模（元）
华夏银行股份有限公司	012283126.IB	22 新疆金投 SCP002	112,257.22

3.4.3 报告期内其他重大关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	交易金额（元）
英大基金管理 有限公司	650957 OTC	英大基金-华英稳健 6号集合资产管理计 划	买入	102,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19KY OTC	中诚信托汇鑫 11 号 集合资金信托计划	买入	30,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19KZ OTC	中诚信托嘉信配置 1 号集合资金信托计 划	买入	50,000,000.00

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份份额分红	每万份现金分红
-	-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品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

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票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	10257000000877250

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。