

华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 36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	华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 36 号
理财产品代码	23111036
A 份额销售代码	23111036A
H 份额销售代码	23111036H
R 份额销售代码	23111036R
Z 份额销售代码	23111036Z
产品登记编码	Z7003923000046
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	163.96%
产品起始日期	2023-08-24
产品终止日期	2025-08-20

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)
2024-09-30	1.0412	269,964,332.00	1.0412	281,100,309.20

H 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)
2024-09-30	1.0412	65,954,631.00	1.0412	68,675,246.79

R 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)
2024-09-30	1.0385	2,000.00	1.0385	2,076.92

Z 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)
2024-09-30	1.0418	300,000,000.00	1.0418	312,547,100.91

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6月30日-2024年9月30日	1.07%
成立以来	2023年8月24日-2024年9月30日	4.12%
2023年	2023年8月24日-2023年12月31日	0.97%

H 份额:

	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	1.07%

成立以来	2023年8月24日-2024年9月30日	4.12%
2023年	2023年8月24日-2023年12月31日	0.97%

R 份额:

	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	1.02%
成立以来	2023年8月24日-2024年9月30日	3.85%
2023年	2023年8月24日-2023年12月31日	0.88%

Z 份额:

	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	1.09%
成立以来	2023年8月24日-2024年9月30日	4.18%
2023年	2023年8月24日-2023年12月31日	0.99%

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	0.12%	0.93%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	99.07%
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	99.88%	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	23 承控 01	债券	57,131,689.15	5.26%
2	20 株城 01	债券	56,911,882.83	5.24%
3	23 西安高新 PPN002	债券	56,653,678.60	5.22%
4	22 涪陵新城 PPN002	债券	56,626,775.83	5.21%
5	20 淮建 02	债券	55,620,637.49	5.12%
6	23 高控 02	债券	52,614,055.58	4.85%
7	22 上投 02	债券	47,278,854.80	4.35%
8	22 滨州城建 MTN001	债券	46,910,174.79	4.32%
9	22 西安高新 PPN002	债券	41,729,931.00	3.84%
10	23 邯建 02	债券	39,051,041.20	3.60%

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）
-	-	-	-

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

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。

5.2.2 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	10250000003338326

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。