

# 华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 5 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：中信银行股份有限公司

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日日开理财产品 5 号
理财产品代码	23112005
A 份额销售代码	23112005A
M 份额销售代码	23112005M
Y 份额销售代码	23112005Y
Z 份额销售代码	23112005Z
产品登记编码	Z7003923000417
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	102.65%
产品起始日期	2023-09-27
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)
2024-09-30	1.0286	8,822,799,102.43	1.0286	9,075,111,369.82

#### M 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	1.0248	860,714,901.80	1.0248	882,094,591.70

#### Y 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	1.0254	4,069,398,870.60	1.0254	4,172,753,195.47

#### 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	1.0190	40,890,514.39	1.0190	41,666,886.53

### 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	0.64%
成立以来	2023年9月27日-2024年9月30日	2.86%
2023年	2023年9月27日-2023年12月31日	0.81%

#### M 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	0.63%

成立以来	2023年11月10日-2024年9月30日	2.48%
2023年	2023年11月10日-2023年12月31日	0.45%

### Y 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	0.63%
成立以来	2023年11月7日-2024年9月30日	2.54%
2023年	2023年11月7日-2023年12月31日	0.49%

### 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	0.60%
成立以来	2024年1月5日-2024年9月30日	1.90%

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	0.05%	44.82%
2	同业存单	0.00%	2.94%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.73%
4	债券	0.00%	47.16%
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%	2.35%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.95%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,094,928,000.93	7.53%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	397,169,532.48	2.73%
3	农业银行南京江宁支行 202310279758	现金及银行存款	247,624,373.45	1.70%
4	农行台州温岭支行 20	现金及银行存款	219,429,528.69	1.51%
5	工行中山银苑支行 9.9	现金及银行存款	216,375,383.90	1.49%
6	中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026	现金及银行存款	209,757,124.65	1.44%
7	农行合肥金寨路支行 20240627	现金及银行存款	186,060,038.45	1.28%
8	农行东莞凤岗支行 20231110	现金及银行存款	161,483,095.69	1.11%
9	中行扬州分行 20231031	现金及银行存款	161,310,080.80	1.11%
10	建设银行开发区支行 202409125324	现金及银行存款	145,275,189.34	1.00%

### 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)
北京农村商业银行股份有限公司	242400018	24 北京农商行永续债 01	5,412,295.59
广发银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	6,857,481.60
首钢集团有限公司	102380491	23 首钢 MTN002	6,930,242.46

#### 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	263280	GC 豫电优	18,777,157.58
招商证券股份有限公司	255210	24 北港 D1	8,486.97
招商证券股份有限公司	262766	5 美好 1B	1,198,385.19
招商证券股份有限公司	263289	京诚 126A	36,122,614.22

#### 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	ZC1A2W	中诚信托-汇鑫 14 号 集合资金信托计划	买入	509,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZXD32Z2023 11010022374	中诚信托-汇鑫 22 号 集合资金信托计划	买入	268,000,000.00



#### 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	8110501013402345004

## 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。