

华夏理财固定收益纯债型四个月定开理财产品 1 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四个月定开理财产品 1 号
理财产品代码	21113001
A 份额销售代码	21113001A
B 份额销售代码	21113001B
C 份额销售代码	21113001C
产品登记编码	Z7003921000389
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	107.60%
产品起始日期	2021-10-15
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	1.0994	344,022,298.13	1.0994	378,223,397.37

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)
2024-09-30	1.1028	167,598,554.37	1.1028	184,820,529.93

C 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	1.0717	4,999,500.05	1.0717	5,357,891.30

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	0.20%
成立以来	2021年10月15日-2024年9月30日	9.94%
2023年	2023年全年	4.27%
2022年	2022年全年	2.36%
2021年	2021年10月15日-2021年12月31日	1.31%

B 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	0.24%
成立以来	2021年10月15日-2024年9月30日	10.28%
2023年	2023年全年	4.38%

2022 年	2022 年全年	2.47%
2021 年	2021 年 10 月 15 日-2021 年 12 月 31 日	1.33%

C 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	0.24%
成立以来	2022 年 6 月 16 日-2024 年 9 月 30 日	7.17%
2023 年	2023 年全年	4.43%
2022 年	2022 年 6 月 16 日-2022 年 12 月 31 日	0.82%

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	6.13%	6.26%
2	同业存单	0.00%	6.91%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	63.71%
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	0.00%	23.13%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	93.87%	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	24 平安银行 CD073	同业存单	42,251,232.59	6.91%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	38,258,364.97	6.26%
3	汇添富长添利定期开放债券 A	公募基金	37,031,008.88	6.05%
4	嘉实汇鑫中短债债券 A	公募基金	21,419,097.76	3.50%
5	交银稳利中短债债券 A	公募基金	21,411,600.88	3.50%
6	国泰丰鑫纯债债券 A	公募基金	21,409,126.34	3.50%
7	平安元丰中短债债券 A	公募基金	21,407,096.55	3.50%
8	24 晋交投 MTN007	债券	21,168,063.03	3.46%
9	21 安吉两山 PPN001	债券	19,325,013.68	3.16%
10	24 南昌建投 MTN002	债券	15,433,232.53	2.52%

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）
中国建设银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	3,885,294.90

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）
招商证券股份有限公司	262766	5 美好 1B	40,137.87
招商证券股份有限公司	263089	5 美意 1A	162,887.98
招商证券股份有限公司	263090	5 美意 1B	43,979.75

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

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，产品投资的债券资产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

截止本报告日，本产品无权益类资产持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000873039

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。