

华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 D 款

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最短持有 7 天理财产品 D 款
理财产品代码	23115013
A 份额销售代码	23115013A
E 份额销售代码	23115013E
F 份额销售代码	23115013F
M 份额销售代码	23115013M
S 份额销售代码	23115013S
V 份额销售代码	23115013V
W 份额销售代码	23115013W
Z 份额销售代码	23115013Z
产品登记编码	Z7003923000419
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	100.21%
产品起始日期	2023-09-26
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	1.0244	3,642,098,740.79	1.0244	3,730,921,138.70

E 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	1.0202	0.99	1.0202	1.01

F 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	1.0237	2,085,894,229.85	1.0237	2,135,252,052.56

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	1.0280	582,935,625.67	1.0280	599,256,023.85

S 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	1.0005	1,099,200,639.49	1.0005	1,099,769,854.83

V 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	1.0234	55,613,840.49	1.0234	56,917,748.13

W 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	1.0234	130,734,612.10	1.0234	133,800,120.24

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	1.0181	39,130,525.93	1.0181	39,837,787.59

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	0.53%
成立以来	2023年11月14日-2024年9月30日	2.44%
2023年	2023年11月14日-2023年12月31日	0.44%

E 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年9月25日-2024年9月30日	1.01%
成立以来	2023年9月26日-2024年9月30日	2.02%
2023年	2023年9月26日-2023年12月31日	0.01%

F 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	0.52%
成立以来	2023年11月14日-2024年9月30日	2.37%
2023年	2023年11月14日-2023年12月31日	0.42%

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	0.53%
成立以来	2023年9月26日-2024年9月30日	2.80%

2023 年	2023 年 9 月 26 日-2023 年 12 月 31 日	0.84%
--------	----------------------------------	-------

S 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024 年 9 月 10 日-2024 年 9 月 30 日	0.05%
成立以来	2024 年 9 月 10 日-2024 年 9 月 30 日	0.05%

V 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	0.52%
成立以来	2023 年 11 月 14 日-2024 年 9 月 30 日	2.34%
2023 年	2023 年 11 月 14 日-2023 年 12 月 31 日	0.42%

W 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	0.47%
成立以来	2023 年 10 月 27 日-2024 年 9 月 30 日	2.34%
2023 年	2023 年 10 月 27 日-2023 年 12 月 31 日	0.57%

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	0.49%
成立以来	2024 年 1 月 8 日-2024 年 9 月 30 日	1.81%

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	4.48%	47.77%
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%	52.23%
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	95.52%	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	1,174,138,713.57	15.03%
2	建行溧阳嘉丰支行 20231215	现金及银行存款	167,611,322.75	2.15%
3	24 高科 02	债券	144,447,016.38	1.85%
4	农业银行无锡惠山支行 202403194043	现金及银行存款	101,137,309.06	1.29%
5	农业银行无锡锡山支行 202403197715	现金及银行存款	101,137,309.06	1.29%
6	农业银行射阳县支行 202403228359	现金及银行存款	101,118,101.53	1.29%
7	中行雄县支行 20240208	现金及银行存款	99,342,502.70	1.27%
8	23 海恒 01	债券	94,217,425.12	1.21%
9	23 赣州城投 MTN003	债券	92,373,569.92	1.18%
10	23 光大环境 MTN003	债券	91,608,459.23	1.17%

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	307,033.12

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	255210	24 北港 D1	20,712,859.98
招商证券股份有限公司	262766	5 美好 1B	119,584.61
招商证券股份有限公司	263089	5 美意 1A	726,156.59
招商证券股份有限公司	263090	5 美意 1B	196,062.28

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	ZXD32Z2023 11010036947	中诚信托-汇鑫 24 号 集合资金信托计划	买入	580,000,000.00

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。本产品系最短持有期产品，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	10257000000946522

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。