

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 360 天理财 产品 A 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 360 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115007
A 份额销售代码	22115007A
B 份额销售代码	22115007B
S 份额销售代码	22115007S
产品登记编码	Z7003922000027
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	115.74%
产品起始日期	2022-03-22
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	1.0841	461,410,835.46	1.0841	500,199,445.85

#### 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	1.0789	119,797,706.48	1.0789	129,244,753.10

#### 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	1.0650	105,133,720.71	1.0650	111,965,894.52

### 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	0.08%
成立以来	2022年3月22日-2024年9月30日	8.41%
2023年	2023年全年	5.80%
2022年	2022年3月22日-2022年12月31日	0.49%

#### 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	0.08%
成立以来	2022年4月26日-2024年9月30日	7.89%
2023年	2023年全年	5.80%
2022年	2022年4月26日-2022年12月31日	0.01%

## S 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	0.11%
成立以来	2022 年 9 月 1 日-2024 年 9 月 30 日	6.50%
2023 年	2023 年全年	5.96%
2022 年	2022 年 9 月 1 日-2022 年 12 月 31 日	-1.54%

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	1.31%	16.08%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.09%
4	债券	0.00%	77.71%
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%	4.12%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.69%	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	95,449,721.07	11.12%
2	24 鲁能源 MTN004	债券	24,999,886.87	2.91%
3	24 吉利汽车 MTN001	债券	24,851,805.88	2.90%
4	24 韵达股份 MTN003	债券	21,360,321.42	2.49%
5	24 三明城投 MTN001	债券	20,377,961.26	2.37%
6	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	17,911,725.48	2.09%
7	24 中国人寿资本补充债 01BC	债券	17,556,276.06	2.05%
8	建设银行开发区支行 202409125324	现金及银行存款	16,801,150.07	1.96%
9	建设银行开发区支行 202409125325	现金及银行存款	16,800,384.84	1.96%
10	22 河北银行永续债	债券	15,272,305.41	1.78%

### 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	25,994.52
首钢集团有限公司	102380491	23 首钢 MTN002	25,395.46

#### 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）
-	-	-	-

#### 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	ZC19HA	中诚信托-嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	55,000,000.00
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	100,000,000.00

#### 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

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

### 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

截至本报告日，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	10257000000881223

## 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。