

华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 A 款

2024 年第 4 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 10 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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 A 款
理财产品代码	22115003
A 份额销售代码	22115003A
B 份额销售代码	22115003B
C 份额销售代码	22115003C
D 份额销售代码	22115003D
H 份额销售代码	22115003H
M 份额销售代码	22115003M
O 份额销售代码	22115003O
W 份额销售代码	22115003W
Z 份额销售代码	22115003Z
产品登记编码	Z7003922000023
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	PR1 级（低风险）
杠杆水平	101.48%
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)
2024-12-31	1.0720	404,840,651.31	1.0720	433,970,127.60

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)
2024-12-31	1.0626	267,163,058.92	1.0626	283,877,514.31

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)
2024-12-31	1.0677	120,153,639.68	1.0677	128,283,526.68

D 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)
2024-12-31	1.0759	26,200,742,446.84	1.0759	28,189,510,501.63

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)
2024-12-31	1.0696	634,664,654.35	1.0696	678,819,973.13

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)
2024-12-31	1.0679	160,358,903.12	1.0679	171,254,363.97

O 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)
2024-12-31	1.0352	284,075,735.82	1.0352	294,068,610.93

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)
2024-12-31	1.0274	2,525,411.95	1.0274	2,594,606.88

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)
2024-12-31	1.0576	38,918.96	1.0576	41,159.62

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09月30日-2024年12月31日	0.49%
成立以来	2022年03月22日-2024年12月31日	7.20%
2023年	2023年全年	2.65%
2022年	2022年03月22日-2022年12月31日	2.04%

B 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.49%
成立以来	2022年07月01日-2024年12月31日	6.26%
2023年	2023年全年	2.65%
2022年	2022年07月01日-2022年12月31日	1.14%

C 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.53%

成立以来	2022年06月15日-2024年12月31日	6.77%
2023年	2023年全年	2.79%
2022年	2022年06月15日-2022年12月31日	1.33%

D 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.52%
成立以来	2022年09月19日-2024年12月31日	6.07%
2023年	2023年全年	2.81%
2022年	2022年09月19日-2022年12月31日	0.66%

H 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.54%
成立以来	2022年06月02日-2024年12月31日	6.96%
2023年	2023年全年	2.85%
2022年	2022年06月02日-2022年12月31日	1.41%

M 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.48%
成立以来	2022年04月29日-2024年12月31日	6.79%
2023年	2023年全年	2.65%
2022年	2022年04月29日-2022年12月31日	1.66%

O 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.52%
成立以来	2023年09月08日-2024年12月31日	3.52%
2023年	2023年09月08日-2023年12月31日	0.97%

W 份额:

	起始和截止时间	净值增长率
--	---------	-------

报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.46%
成立以来	2023年10月27日-2024年12月31日	2.74%
2023年	2023年10月27日-2023年12月31日	0.48%

Z 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年09月30日-2024年12月31日	0.48%
成立以来	2022年08月11日-2024年12月31日	5.76%
2023年	2023年全年	2.61%
2022年	2022年08月11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	银行存款、债券买入返售、债券等固定收益类资产	7.36%	92.00%
2	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
3	权益类投资	0.00%	0.00%
4	金融衍生品	0.00%	0.00%
5	代客境外理财投资 QDII	0.00%	0.00%
6	商品类资产	0.00%	0.00%
7	另类资产	0.00%	0.00%
8	公募基金	6.63%	8.00%
9	私募基金	0.00%	0.00%
10	资产管理产品	86.01%	0.00%
11	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	拆放同业及债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	2,750,913,948.80	8.98%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	2,142,198,309.81	6.99%
3	农行定期存款 20(20220610)	现金及银行存款	983,136,721.32	3.21%
4	工行定期存款 9.9(20220728)	现金及银行存款	969,481,609.86	3.17%
5	农业银行清远分行 202307207337	现金及银行存款	496,309,113.34	1.62%
6	农业银行清远分行 202307207358	现金及银行存款	496,309,113.34	1.62%
7	农业银行英德市分行 202307207329	现金及银行存款	496,309,113.34	1.62%
8	农业银行 202307273909	现金及银行存款	495,181,408.57	1.62%
9	工商银行 9.9(20220630)	现金及银行存款	485,855,801.39	1.59%
10	工行定期存款 9.8(20220722)	现金及银行存款	480,080,874.55	1.57%

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)
兴业银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	10,472,658.99
中国建设银行股份有限公司	112405126	24 建设银行 CD126	8,784,247.62
中国建设银行股份有限公司	2028033	20 建设银行二级	7,659,023.96
中国建设银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	2,065,673.29

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	144789	24 国电投海南绿色 ABS 优	572,436.70
开源证券股份有限公司	082482249	24 浙海宗正 ABN002 优 先	1,045,616.99
首创证券股份有限公司	144725	24 橙融 2A	473,664.95
首创证券股份有限公司	256469	24 雨山 01	1,081,796.68
招商证券股份有限公司	134092	24 穗开 Y6	22,461,459.91
招商证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	1,098,494.23
招商证券股份有限公司	263439	予鑫 3B	285,949.92

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	ZXD32Z2024 01010032472	中诚信托-汇鑫 30 号	买入	229,950,000.00
中诚信托有	ZXD32Z2024	中诚信托-汇鑫 32 号	买入	155,400,000.00

限责任公司	01010055251			
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2024 08010070276	中诚信托-汇鑫 55 号	买入	116,000,000.00

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,合理配置货币类、债券类、权益类资产(优先股),通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,产品持有的现金等高流动性资产比例符合要求,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,产品投资的债券资产总体资质较优,债券价格波动对组合净值波动的影响保持在可控范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

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	10257000000881041

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。