

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 30 天理财产品 F 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：兴业银行股份有限公司

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 30 天理财产品 F 款
理财产品代码	24115011
O 份额销售代码	24115011O
V 份额销售代码	24115011V
Z 份额销售代码	24115011Z
产品登记编码	Z7003924000267
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	105.37%
产品起始日期	2024-05-27
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

#### 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	1.016176	2,317,205,332.75	1.016176	2,354,688,029.32

#### 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)
2024-12-31	1.015628	574,250,751.76	1.015628	583,225,411.33

#### 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	1.015354	188,981,810.31	1.015354	191,883,463.42

### 2.2 净值增长率

#### 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	0.57%
成立以来	2024年05月27日-2024年12月31日	1.62%

#### V 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	2024年05月27日-2024年12月31日	1.56%

#### 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	0.53%
成立以来	2024年05月27日-2024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	6.55%	32.54%
2	同业存单	0.00%	0.43%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	3.75%
4	债券	0.00%	53.35%
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%	9.92%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	93.45%	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	农业银行合肥经济技术 35 (20240628)	现金及银行存款	497,462,097.98	15.08%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	232,115,398.65	7.04%
3	农行合肥 20240627	现金及银行存款	226,640,681.26	6.87%
4	拆放同业及债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	123,646,627.51	3.75%
5	财通多利债券 C	公募基金	93,384,118.14	2.83%
6	财通安益中短债债券 A	公募基金	58,358,513.22	1.77%
7	19 冶 23A	债券	49,016,941.47	1.49%
8	24 声赫漳龙 2ABN002 优先	债券	47,024,571.80	1.43%
9	兴证全球恒远债券 A	公募基金	43,681,211.50	1.32%
10	23 中铁 01	债券	36,823,777.52	1.12%

### 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）
开源证券股份有限公司	072410275	24 开源证券 CP003	20,712,054.12

#### 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	134092	24 穗开 Y6	19,265,911.65
招商证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	1,635,707.35

#### 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 11010022374	中诚信托-汇鑫 22 号	买入	350,000,000.00

#### 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	356980100102667020

## 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。