

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 200 天理财 产品 B 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 200 天理财产品 B 款
理财产品代码	23115016
A 份额销售代码	23115016A
C 份额销售代码	23115016C
F 份额销售代码	23115016F
V 份额销售代码	23115016V
产品登记编码	Z7003923000418
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	102.93%
产品起始日期	2023-11-09
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	1.0357	1,979,889,219.49	1.0357	2,050,550,863.12

#### 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	1.0236	1,205,114,982.92	1.0236	1,233,500,913.60

#### 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)
2024-12-31	1.0115	60,000,000.00	1.0115	60,688,946.81

#### 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	1.0171	188,008,462.22	1.0171	191,218,833.20

### 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	0.62%
成立以来	2023年11月09日-2024年12月31日	3.57%
2023年	2023年11月09日-2023年12月31日	0.50%

#### 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	0.62%

成立以来	2024年03月12日-2024年12月31日	2.36%
------	-------------------------	-------

**F 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	0.64%
成立以来	2023年11月09日-2024年12月31日	1.15%

**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	0.59%
成立以来	2024年05月27日-2024年12月31日	1.71%

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	6.27%	29.07%
2	同业存单	0.00%	0.08%
3	拆放同业及债券买入返售	3.98%	12.03%
4	债券	0.00%	50.94%
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%	7.88%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	89.75%	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	拆放同业及债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	437,799,238.94	12.03%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	335,982,539.96	9.23%
3	中行扬州分行 20231031	现金及银行存款	126,582,708.40	3.48%
4	建行 20230921	现金及银行存款	63,306,231.47	1.74%
5	建行 20230921	现金及银行存款	63,306,231.47	1.74%
6	建行 20230921	现金及银行存款	63,306,231.47	1.74%
7	建行 20230920	现金及银行存款	63,224,540.58	1.74%
8	建行镇江分行 20230927	现金及银行存款	63,189,186.15	1.74%
9	24 津材 01	债券	58,337,502.46	1.60%
10	财通多利债券 C	公募基金	55,342,627.55	1.52%

### 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)
开源证券股份有限公司	072410275	24 开源证券 CP003	9,432,669.69

#### 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)
首创证券股份有限公司	144725	24 橙融 2A	330,797.28
招商证券股份有限公司	134092	24 穗开 Y6	20,562,150.43
招商证券股份有限公司	144710	荟享 18 号第 5 期优先 A 级(第 1 期次)	5,056,631.42
招商证券股份有限公司	144711	荟享 18 号第 5 期优先 B 级(第 1 期次)	350,074.48
招商证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	300,361.30

#### 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	买入	51,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC1A2W	中诚信托-汇鑫 14 号	买入	478,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2023 11010022374	中诚信托-汇鑫 22 号	买入	3,000,000.00



#### 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	10257000000948790

## 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。