

# 华夏理财固定收益纯债型一年定开理财产品 9 号

## 2024 年年度报告

### 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、天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）对本理财产品的财务报表进行了审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。
- 3、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 1 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型一年定开理财产品 9 号
理财产品代码	22113009
A 份额销售代码	22113009A
B 份额销售代码	22113009B
产品登记编码	Z7003922000082
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式净值型
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	102.00%
产品起始日期	2022-07-26
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)
2024-12-31	1.0703	1,508,628.74	1.0723	1,614,754.39

#### 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	1.0733	229,839,647.91	1.0753	246,697,953.59

### 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	2023 年 12 月 31 日-2024 年 12 月 31 日	2.41%
成立以来	2022 年 07 月 26 日-2024 年 12 月 31 日	7.23%
2023 年	2023 年全年	5.83%
2022 年	2022 年 07 月 26 日-2022 年 12 月 31 日	-1.06%

#### B 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2023 年 12 月 31 日-2024 年 12 月 31 日	2.53%
成立以来	2022 年 07 月 26 日-2024 年 12 月 31 日	7.53%
2023 年	2023 年全年	5.96%
2022 年	2022 年 07 月 26 日-2022 年 12 月 31 日	-1.02%

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	0.33%	1.59%
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%	94.87%
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%	3.54%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.67%	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	21 武汉旅游 MTN002	债券	7,360,578.30	2.91%
2	23 创兴银行二级资本债 01BC	债券	5,287,571.36	2.09%
3	20 眉控 01	债券	4,989,342.01	1.97%
4	22 宣城经开 PPN001	债券	4,908,147.67	1.94%
5	23 弘湘国投 PPN001	债券	4,601,824.43	1.82%
6	22 首股 02	债券	4,593,208.81	1.81%
7	22 牛首山 PPN003	债券	4,499,270.91	1.78%
8	21 上投 01	债券	4,233,876.73	1.67%
9	23 洛阳城乡 PPN002	债券	4,098,843.59	1.62%
10	22 新会 01	债券	4,026,555.48	1.59%

### 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）
兴业国信资产管理有限 公司	240805	24 兴信 01	11,785,168.99
兴业银行股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	13,474,821.90

#### 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	143930	庐陵二 3A	3,622,301.88

#### 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）
-	-	-	-	-

#### 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	10257000000891253

## 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。

## 第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品  
在投资运作过程中存在违反法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。