

华夏理财固定收益纯债最短持有 60 天理财 产品 A 款

2022 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：2022 年 10 月 01 日至 2022 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 60 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115006
A 份额销售代码	22115006A
B 份额销售代码	22115006B
C 份额销售代码	22115006C
E 份额销售代码	22115006E
M 份额销售代码	22115006M
N 份额销售代码	22115006N
V 份额销售代码	22115006V
产品登记编码	Z7003922000026
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	135.97%
产品起始日期	2022-03-22
产品终止日期	无特定存续期限

第二章 净值、存续规模及收益表现

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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	1.0118	1,351,070,166.20	1.0118	1,366,968,004.19	-0.97%
2022-09-30	1.0217	3,578,585,701.27	1.0217	3,656,363,572.95	

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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	0.9992	44,861,185.77	0.9992	44,823,500.91	-0.97%
2022-09-30	1.0090	131,200,076.94	1.0090	132,382,918.40	

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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	1.0013	616,880,407.11	1.0013	617,691,180.18	-0.94%
2022-09-30	1.0108	2,355,658,501.28	1.0108	2,381,089,465.22	

E 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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	1.0124	6,152,226.19	1.0124	6,228,393.24	-0.93%
2022-09-30	1.0219	18,891,536.75	1.0219	19,304,408.18	

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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	1.0002	42,169,916.86	1.0002	42,176,481.60	-0.97%
2022-09-30	1.0100	125,786,665.75	1.0100	127,048,192.18	

N 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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	1.0013	12,372,231.61	1.0013	12,388,612.28	-0.93%
2022-09-30	1.0107	19,093,868.06	1.0107	19,297,724.56	

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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	0.9892	500,000,000.00	0.9892	494,580,830.42	-1.08%
2022-10-14	1.0000	-	1.0000	-	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*100%

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	0.93%	22.32%
2	同业存单	0.00%	3.96%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.22%
4	债券	0.00%	72.35%
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%	1.15%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.07%	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。

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	539,057,692.59	15.34%
2	农行台州温岭支行 20(20220610)	现金及银行存款	62,080,387.41	1.77%
3	工行中山银苑支行 9.9(20220728)	现金及银行存款	61,205,914.69	1.74%
4	20 民生银行二级	债券	52,810,469.38	1.50%
5	工商银行佛山高明沧江支行 9.9(20220630)	现金及银行存款	30,676,944.09	0.87%
6	工行中山西区支行 9.8(20220722)	现金及银行存款	30,309,530.72	0.86%
7	工行中山城北支行 9.7(20220722)	现金及银行存款	30,000,249.80	0.85%
8	21 襄阳 01	债券	23,567,127.02	0.67%
9	20 新密 01	债券	21,527,042.33	0.61%
10	22 海恒 K2	债券	18,105,940.57	0.52%

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	买入规模（元）
-	-	-	-

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	买入规模（元）
华夏银行股份有限公司	102282373.IB	22 鹤壁投资 MTN003	827,246.78
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	1,981,711.91

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	交易金额（元）
-	-	-	-	-

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份份额分红	每万份现金分红
-	-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

产品流动性较好，同时储备以一定比例的现金及银行存款，目前无潜在流动性风险。

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 产品股票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	10257000000881074

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。