

华夏理财固定收益纯债最短持有 14 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 14 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115004
A 份额销售代码	22115004A
B 份额销售代码	22115004B
C 份额销售代码	22115004C
H 份额销售代码	22115004H
M 份额销售代码	22115004M
N 份额销售代码	22115004N
Z 份额销售代码	22115004Z
产品登记编码	Z7003922000024
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	119.80%
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	1.0140	664,203,387.28	1.0140	673,527,351.06	-0.60%
2022-09-30	1.0201	3,021,979,979.75	1.0201	3,082,764,367.35	

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	1.0021	12,379,344.75	1.0021	12,405,439.27	-0.60%
2022-09-30	1.0081	26,626,711.56	1.0081	26,842,247.04	

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	1.0046	878,382,501.01	1.0046	882,466,639.39	-0.56%
2022-09-30	1.0103	4,129,046,645.53	1.0103	4,171,520,628.88	

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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	1.0052	434,272,285.35	1.0052	436,546,097.82	-0.55%
2022-09-30	1.0108	1,780,798,321.04	1.0108	1,799,962,087.55	

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	1.0040	74,472,130.08	1.0040	74,771,901.46	-0.60%
2022-09-30	1.0101	353,540,565.66	1.0101	357,094,522.42	

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	1.0051	16,282,833.40	1.0051	16,366,543.16	-0.55%
2022-09-30	1.0107	68,165,829.06	1.0107	68,892,364.47	

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)	期间累计净 值增长率
2022-12-31	0.9954	392,468.75	0.9954	390,662.98	-0.59%
2022-09-30	1.0013	30,550.00	1.0013	30,590.96	

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	0.28%	32.92%
2	同业存单	0.00%	20.35%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.90%
4	债券	0.00%	45.83%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.71%	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	18 国开 11	债券	286,814,089.85	11.42%
2	农行台州温岭支行 20(20220610)	现金及银行存款	205,416,129.09	8.18%
3	工行中山银苑支行 9.9(20220728)	现金及银行存款	202,522,609.75	8.06%
4	20 晋天然气 PPN001	债券	104,257,092.42	4.15%
5	工商银行佛山高明沧江支行 9.9(20220630)	现金及银行存款	101,506,117.64	4.04%
6	工行中山西区支行 9.8(20220722)	现金及银行存款	100,290,393.39	3.99%
7	工行中山城北支行 9.7(20220722)	现金及银行存款	99,267,022.03	3.95%
8	22 江苏银行 CD108	同业存单	98,662,135.10	3.93%
9	22 北京银行 CD153	同业存单	97,988,900.07	3.90%
10	22 南安 D1	债券	69,468,957.42	2.77%

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	102282472.IB	22 胶州湾 MTN002	1,129,800.25
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	15,854,257.75

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

本产品为高频开放产品，产品配置高流动、可快速变现资产规模不低于 50%，应对每日可能出现的申赎。报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控。

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

本产品主要配置货币市场工具、利率债、同业存单和国企、央企城投债，信用风险水平相对较低。产品组合久期控制在 1 以内，价格波动水平整体可控。

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	10257000000881052

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。