

华夏理财固定收益纯债最短持有 14 天理财 产品 A 款

2023 年第 3 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：2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 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	100.35%
产品起始日期	2022-03-22
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

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
2023-09-30	1.0372	300,162,396.08	1.0372	311,321,476.37	0.66%
2023-06-30	1.0304	394,042,799.02	1.0304	406,027,385.38	

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
2023-09-30	1.0250	42,557,355.61	1.0250	43,620,457.90	0.66%
2023-06-30	1.0183	39,873,568.98	1.0183	40,603,120.24	

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
2023-09-30	1.0287	496,513,700.27	1.0287	510,781,832.00	0.69%
2023-06-30	1.0216	709,502,299.13	1.0216	724,854,550.17	

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
2023-09-30	1.0297	545,051,226.11	1.0297	561,262,632.17	0.70%
2023-06-30	1.0225	602,741,991.97	1.0225	616,306,283.01	

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
2023-09-30	1.0272	116,573,820.78	1.0272	119,742,400.45	0.69%
2023-06-30	1.0202	92,552,465.98	1.0202	94,425,001.98	

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
2023-09-30	1.0297	10,243,754.45	1.0297	10,547,927.77	0.71%
2023-06-30	1.0224	12,559,660.78	1.0224	12,841,618.12	

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
2023-09-30	1.0827	94,168.95	1.0827	101,958.37	7.05%
2023-06-30	1.0114	124,396.91	1.0114	125,818.16	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值*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	0.04%	53.46%
2	同业存单	0.00%	3.39%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	3.41%
4	债券	0.00%	39.61%
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%	0.13%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.96%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	158,302,179.07	10.13%
2	22 南安 D1	债券	71,813,987.31	4.60%
3	23 津城建 CP014	债券	69,303,594.48	4.43%
4	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	53,266,113.56	3.41%
5	22 乌高新 MTN001	债券	51,620,370.68	3.30%
6	23 农业银行 CD098	同业存单	49,206,439.42	3.15%
7	23 津投 21	债券	36,568,349.25	2.34%
8	23 环球 Y3	债券	28,831,939.06	1.84%
9	农行泰州姜堰支行	现金及银行存款	25,117,293.88	1.61%
10	工行望城支行 3	现金及银行存款	25,021,754.84	1.60%

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）
-	-	-	-

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）
-	-	-	-

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）
英大保险资产管理有限公司	601082 OTC	英大资产-聚鑫 11 号 保险资管产品	买入	10,000,000.00

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置现金类、债券类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前组合流动性风险可控。

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

截至本报告日,债券价格波动处于市场合理区间范围。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截至本报告日,无衍生品持仓。

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。