

华夏理财固定收益增强最短持有 100 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	华夏理财固定收益增强最短持有 100 天理财产品 A 款
理财产品代码	22135008
A 份额销售代码	22135008A
F 份额销售代码	22135008F
S 份额销售代码	22135008S
产品登记编码	Z7003922000121
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	101.38%
产品起始日期	2022-11-10
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	1.0291	7,564,413,702.45	1.0291	7,784,492,221.16	0.69%
2023-06-30	1.0220	3,383,742,247.67	1.0220	3,458,153,368.53	

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)	期间累计净 值增长率
2023-09-30	1.0291	1,769,922,890.81	1.0291	1,821,443,653.89	0.69%
2023-06-30	1.0220	114,830,390.95	1.0220	117,353,874.10	

S 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	1.0002	1,000,000.00	1.0002	1,000,172.31	0.02%
2023-09-27	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	0.44%	57.28%
2	同业存单	0.00%	0.64%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.96%
4	债券	8.14%	37.22%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.06%
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	3.12%	3.84%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	88.30%	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	1,069,510,980.10	10.98%
2	农行天津滨海分行 20230906/12	现金及银行存款	480,760,433.11	4.94%
3	农行北京门头沟支行 20230908/8	现金及银行存款	320,457,129.63	3.29%
4	平安如意中短债 A	公募基金	300,297,560.48	3.08%
5	农行珠海分行 20230927-10	现金及银行存款	233,626,426.56	2.40%
6	建行淮安楚州支行 20230927-10	现金及银行存款	233,626,426.56	2.40%
7	建行淮安洪泽支行 20230927-10	现金及银行存款	233,626,426.56	2.40%
8	农行清远分行英德支行 2023072702-7	现金及银行存款	131,877,062.98	1.35%
9	19 新锦 01	债券	116,907,274.46	1.20%
10	19 信投 03	债券	112,366,630.51	1.15%

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）
国信证券股份有限公司	133647.SZ	23 渝隆 04	23,817,408.65

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	82,000,000.00
英大基金管理有限公司	ydhywj02 OTC	英大基金-华英稳健 2 号集合资产管理计 划	买入	520,000,000.00

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

流动性风险管理方面，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、正逆回购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；三是产品持有一定比例的高流动性资产，赎回期内主要通过正回购操作或卖出部分资产变现，满足产品的流动性需求。

5.2 投资组合投资风险分析

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

截止本报告日，本产品投资的债券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

截至本报告日，产品投资的权益资产价格波动对组合净值的影响保持在可控范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10250000003316573

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。