

华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 15 号

2022 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：中国农业银行股份有限公司

报 告 期：2022 年 08 月 19 日至 2022 年 09 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 15 号
理财产品代码	22111015
产品登记编码	Z7003922000087
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式
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	125.86%
产品起始日期	2022-08-19
产品终止日期	2022-12-28

第二章 净值、存续规模及收益表现

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
2022-09-30	0.9988	64,649,111.00	0.9988	64,572,365.47	-0.12%
2022-08-19	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	1.00%	1.21%
2	同业存单	0.00%	0.23%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	5.35%
4	债券	0.00%	82.34%
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%	10.88%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.00%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	4,345,089.99	5.35%
2	21 拱墅 03	债券	4,255,658.49	5.24%
3	富国双债增强债券 A	公募基金	3,636,599.81	4.47%
4	G20 天成 2	债券	3,159,999.04	3.89%
5	国投瑞银优化增强 AB	公募基金	2,078,045.76	2.56%
6	20 滨建 01	债券	1,887,148.39	2.32%
7	21 深担 01	债券	1,670,949.14	2.06%
8	21 富湾 03	债券	1,611,144.67	1.98%
9	21 国开 10	债券	1,498,228.43	1.84%
10	20 海尖 01	债券	1,476,325.58	1.82%

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	012283126.IB	22 新疆金投 SCP002	71,000.16

3.4.3 报告期内其他重大关联交易

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类,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

本产品持有债券未出现信用违约等信用风险事件,三季度债券收益率整体呈下行态势,有一定资本利得收益贡献,整体波动率在合理区间范围内。

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	26493001040015507

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。