

华夏理财固定收益纯债最短持有 30 天理财 产品 A 款

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：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2022 年 07 月 01 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最短持有 30 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115005
A 份额销售代码	22115005A
B 份额销售代码	22115005B
C 份额销售代码	22115005C
D 份额销售代码	22115005D
G 份额销售代码	22115005G
H 份额销售代码	22115005H
M 份额销售代码	22115005M
X 份额销售代码	22115005X
产品登记编码	Z7003922000025
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	105.06%
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
2022-09-30	1.0179	2,996,263,896.67	1.0179	3,049,749,022.20	0.71%
2022-06-30	1.0107	4,103,227,233.78	1.0107	4,146,943,384.48	

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
2022-09-30	1.0079	11,464,525.43	1.0079	11,555,180.69	0.79%
2022-07-01	1.0000	-	1.0000	-	

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
2022-09-30	1.0133	521,169,077.35	1.0133	528,106,515.23	0.75%
2022-06-30	1.0058	63,869,035.01	1.0058	64,236,999.79	

D 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
2022-09-30	1.0117	5,570,947,811.67	1.0117	5,635,971,886.68	0.76%
2022-06-30	1.0041	397,778,155.58	1.0041	399,402,692.70	

G 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
2022-09-30	1.0020	13,993,810.09	1.0020	14,021,733.68	0.20%
2022-08-22	1.0000	-	1.0000	-	

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
2022-09-30	1.0096	461,766,540.47	1.0096	466,206,420.65	0.76%
2022-06-30	1.0020	217,209,141.33	1.0020	217,633,131.61	

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
2022-09-30	1.0136	3,279,883,031.50	1.0136	3,324,331,803.98	0.76%
2022-06-30	1.0060	2,595,365,887.21	1.0060	2,610,920,551.21	

X 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
2022-09-30	1.0096	15,357,720.22	1.0096	15,505,913.96	0.76%
2022-06-30	1.0020	7,680,476.12	1.0020	7,695,828.32	

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	0.53%	40.32%
2	同业存单	0.00%	11.07%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.21%
4	债券	0.00%	38.26%
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	3.63%	8.15%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	95.84%	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	现金及银行存款	现金及银行存款	1,387,125,118.40	10.12%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	302,446,414.34	2.21%
3	农行台州温岭支行 20(20220610)	现金及银行存款	267,705,930.23	1.95%
4	工行中山银苑支行 9.9(20220728)	现金及银行存款	263,926,456.86	1.93%
5	中国建设银行泉州分行	现金及银行存款	263,754,722.38	1.92%
6	22 中远 3A	债券	252,893,363.53	1.85%
7	他行存款	现金及银行存款	246,961,305.10	1.80%
8	新华交行定存(2020)8 号	现金及银行存款	227,077,928.17	1.66%
9	新华建行东莞市分行 1 号	现金及银行存款	151,101,073.80	1.10%
10	新华广州定存(2021)1 号	现金及银行存款	148,197,682.81	1.08%

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）
鲁能集团有限公司	137819.SH	22 鲁能 02	1,024,329.48

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	2,641,512.03
华夏银行股份有限公司	042280372.IB	22 武清国资 CP004	1,031,038.87
华夏银行股份有限公司	102281527.IB	22 长发集团 MTN002	589,371.75
华夏银行股份有限公司	102281669.IB	22 武汉生态 MTN001	694,827.64
华夏银行股份有限公司	102281789.IB	22 武汉生态 MTN002	3,483,473.93
华夏银行股份有限公司	102281971.IB	22 桂铁投 MTN005	1,716,346.13
华夏银行股份有限公司	102282173.IB	22 长沙城投 MTN001A	454,527.96

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）
英大保险资产管理有限公司	YD-HLYJ OTC	英大资产活利壹玖 资产管理产品	买入	350,000,000.00
英大基金管理有限公司	ydhwj01 OTC	英大基金-华英稳健 1号集合资产管理计 划	买入	260,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	60,000,000.00
中国人保资 产管理有限 公司	RBWY03 OTC	中国人保资产稳盈 专享 3 号资产管理 产品	买入	100,000,000.00

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	10257000000881063

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。