

# 华夏理财固定收益增强最短持有 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     | 华夏理财固定收益增强最短持有 30 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码   | 22135006                    |
| A 份额销售代码 | 22135006A                   |
| H 份额销售代码 | 22135006H                   |
| Y 份额销售代码 | 22135006Y                   |
| Z 份额销售代码 | 22135006Z                   |
| 产品登记编码   | Z7003922000021              |
| 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     | 108.34%                     |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)         | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)         | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0181      | 2,107,433,934.13 | 1.0181      | 2,145,484,276.26 | 0.70%         |
| 2022-06-30 | 1.0110      | 3,559,935,069.20 | 1.0110      | 3,599,187,433.56 |               |

### H 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0096      | 231,071,766.26 | 1.0096      | 233,281,753.80 | 0.75%         |
| 2022-06-30 | 1.0021      | 157,441,509.94 | 1.0021      | 157,767,470.28 |               |

### Y 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份) | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元) | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------|-------------|----------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0022      | 210.00   | 1.0022      | 210.46   | 0.22%         |
| 2022-08-19 | 1.0000      | -        | 1.0000      | -        |               |

### Z 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份) | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元) | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------|-------------|----------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0031      | 200.00   | 1.0031      | 200.61   | 0.31%         |
| 2022-08-11 | 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       | 2.80%     | 50.73%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 16.08%    |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 1.64%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 17.67%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 0.87%     |
| 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          | 9.65%     | 13.01%    |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 87.55%    | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|-------------------------------|---------|----------------|-------------|
| 1  | 现金及银行存款                       | 现金及银行存款 | 333,832,388.74 | 12.95%      |
| 2  | 农行台州温岭支行 20(20220610)         | 现金及银行存款 | 116,065,865.29 | 4.50%       |
| 3  | 工行中山银苑支行 9.9(20220728)        | 现金及银行存款 | 114,427,246.95 | 4.44%       |
| 4  | 创金合信恒兴中短债 A                   | 公募基金    | 100,422,678.60 | 3.90%       |
| 5  | 工行长沙司门口支行 1                   | 现金及银行存款 | 65,066,015.30  | 2.52%       |
| 6  | 工商银行佛山高明沧江支行<br>9.9(20220630) | 现金及银行存款 | 57,353,028.38  | 2.23%       |
| 7  | 工行中山西区支行 9.8(20220722)        | 现金及银行存款 | 56,665,278.83  | 2.20%       |
| 8  | 工行中山城北支行 9.7(20220722)        | 现金及银行存款 | 56,087,061.69  | 2.18%       |
| 9  | 工行长沙司门口支行 4                   | 现金及银行存款 | 52,052,812.24  | 2.02%       |
| 10 | 工行长沙司门口支行 3                   | 现金及银行存款 | 45,546,210.71  | 1.77%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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）      |
|-------------------|--------------|-----------------|--------------|
| 北京科技园建设（集团）股份有限公司 | 032200226.IB | 22 京科技园 PPN001A | 1,142,807.18 |
| 鲁能集团有限公司          | 137819.SH    | 22 鲁能 02        | 111,518.12   |

#### 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       | 1,208,177.96 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032280716.IB | 22 连云城建 PPN004       | 833,362.02   |
| 华夏银行股份有限公司 | 042280372.IB | 22 武清国资 CP004        | 1,237,113.75 |
| 华夏银行股份有限公司 | 092280061.IB | 22 长沙农商行二级资本<br>债 01 | 110,234.49   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002       | 597,029.18   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281864.IB | 22 豫投资 MTN002        | 1,190,517.17 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281971.IB | 22 桂铁投 MTN005        | 904,710.53   |

#### 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）       |
|----------------|------------|-----------------------------|------|---------------|
| 英大基金管理有限公司     | 000912 OTC | 英大现金宝 A                     | 买入   | 40,000,000.00 |
| 英大基金管理有限公司     | 650952 OTC | 英大基金-华英稳健<br>3号集合资产管理计<br>划 | 买入   | 60,000,000.00 |
| 英大基金管理有限公司     | 650957 OTC | 英大基金-华英稳健<br>6号集合资产管理计<br>划 | 买入   | 30,000,000.00 |
| 中诚信托有<br>限责任公司 | ZC19KZ OTC | 中诚信托嘉信配置 1<br>号集合资金信托计<br>划 | 买入   | 10,000,000.00 |
| 中诚信托有          | ZC19L1 OTC | 中诚信托嘉信配置 2                  | 买入   | 9,000,000.00  |

|           |  |                      |  |  |
|-----------|--|----------------------|--|--|
| 限 责 任 公 司 |  | 号 集 合 资 金 信 托 计<br>划 |  |  |
|-----------|--|----------------------|--|--|

#### 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、权益类资产,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,产品投资的债券资产总体资质较优,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

本产品持有的股票仓位相对保守,价格波动对组合净值波动率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

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 | 10257000000881245 |

## **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。