

华夏理财固定收益增强最短持有 720 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 720 天理财产品 A 款
理财产品代码	22135005
A 份额销售代码	22135005A
Y 份额销售代码	22135005Y
Z 份额销售代码	22135005Z
产品登记编码	Z7003922000017
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	113.71%
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	1.0222	713,696,743.70	1.0222	729,514,221.70	0.70%
2022-06-30	1.0151	242,267,923.09	1.0151	245,933,099.36	

Y 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	0.9981	20,199.01	0.9981	20,161.42	-0.19%
2022-08-19	1.0000	-	1.0000	-	

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
2022-09-30	1.0010	102.00	1.0010	102.10	0.10%
2022-08-12	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	0.80%	0.87%
2	同业存单	0.00%	0.36%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.16%
4	债券	0.00%	95.20%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.05%
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	3.75%	3.37%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	95.44%	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	21 渤海银行二级	债券	48,288,593.44	5.82%
2	22 华融湘江二级资本债 01	债券	30,581,283.12	3.69%
3	19 军融 02	债券	22,399,782.16	2.70%
4	22 安租 Y2	债券	20,601,526.03	2.48%
5	22 恒丰银行永续债	债券	18,360,135.34	2.21%
6	22 珠海九洲 MTN001	债券	14,685,085.25	1.77%
7	22 河北银行永续债	债券	14,269,847.20	1.72%
8	22 镇交 04	债券	13,858,871.68	1.67%
9	22 安控 02	债券	13,166,765.73	1.59%
10	19 昆交 05	债券	12,719,786.60	1.53%

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	38,284.79
华夏银行股份有限公司	042280372.IB	22 武清国资 CP004	222,037.93
华夏银行股份有限公司	092280061.IB	22 长沙农商行二级资本 债 01	6,120,624.84
华夏银行股份有限公司	102281527.IB	22 长发集团 MTN002	594,650.25
华夏银行股份有限公司	102281971.IB	22 桂铁投 MTN005	1,289,561.06

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

本产品持有较高比例的高流动性资产，报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控。

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

本产品主要配置货币市场工具、利率债、同业存单和国企、央企城投债，信用风险水平相对较低，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

截至本报告日，产品投资的权益资产价格波动处于市场合理区间范围内。

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	10257000000881369

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。