

华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 A 款

2023 年半年度报告

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 1 月 1 日至 2023 年 6 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 7 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115003
A 份额销售代码	22115003A
B 份额销售代码	22115003B
C 份额销售代码	22115003C
D 份额销售代码	22115003D
H 份额销售代码	22115003H
M 份额销售代码	22115003M
Z 份额销售代码	22115003Z
产品登记编码	Z7003922000023
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	PR1 级（低风险）
杠杆水平	101.00%
产品起始日期	2022-03-22
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
2023-06-30	1.0332	728,787,314.85	1.0332	752,950,656.56	1.25%
2022-12-31	1.0204	1,142,959,809.88	1.0204	1,166,284,580.34	

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
2023-06-30	1.0241	175,678,938.45	1.0241	179,913,776.15	1.26%
2022-12-31	1.0114	2,118,865.46	1.0114	2,143,050.58	

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
2023-06-30	1.0267	50,540,090.45	1.0267	51,889,272.00	1.32%
2022-12-31	1.0133	2,404,487.75	1.0133	2,436,452.86	

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
2023-06-30	1.0346	161,191,294.95	1.0346	166,774,055.71	1.33%
2022-12-31	1.0210	74,274,364.50	1.0210	75,835,581.67	

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
2023-06-30	1.0278	256,417,464.69	1.0278	263,537,461.47	1.35%
2022-12-31	1.0141	254,177,525.87	1.0141	257,766,231.13	

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
2023-06-30	1.0293	222,955,452.92	1.0293	229,480,893.20	1.25%
2022-12-31	1.0166	389,292,124.08	1.0166	395,743,105.34	

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
2023-06-30	1.0209	129,951.51	1.0209	132,668.33	1.26%
2022-12-31	1.0082	3,019,278.96	1.0082	3,044,083.72	

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	1.58%	80.21%
2	同业存单	0.00%	1.50%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	10.32%
4	债券	0.00%	7.02%
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%	0.95%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.42%	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”类别中包含永续债和优先股。

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	274,843,382.45	16.54%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	171,428,114.71	10.32%
3	建设银行江苏南京 23033101/30 亿	现金及银行存款	37,693,139.18	2.27%
4	建设银行重庆观音桥 23032801/20 亿	现金及银行存款	25,132,263.16	1.51%
5	建设银行江苏南京 23033102/20 亿	现金及银行存款	25,128,759.46	1.51%
6	农业江苏南京 23033002/20 亿	现金及银行存款	25,127,901.27	1.51%
7	农业江苏南京 23033003/20 亿	现金及银行存款	25,127,901.27	1.51%
8	他行存款	现金及银行存款	17,160,288.95	1.03%
9	建设银行秦皇岛港口专业支行 202305125604	现金及银行存款	16,318,515.60	0.98%
10	建设银行秦皇岛港口专业支行 202305125605	现金及银行存款	16,318,515.60	0.98%

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）
-	-	-	-

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	50,000,000.00
英大保险资产管理有限公司	YDDC01 OTC	英大资产-聚鑫 8 号 保险资管产品	买入	125,300,000.00
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	110,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC19KZ OTC	中诚信托嘉信配置 1 号集合资金信托计划	买入	10,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC19RI OTC	中诚信托汇鑫 12 号 集合资金信托计划	买入	5,700,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC1A3M OTC	中诚信托汇鑫 16 号 集合资金信托计划	买入	245,300,000.00

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置现金类、债券类资产,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,债券价格波动处于市场合理区间范围。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截至本报告日,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	10257000000881041

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。

第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品存在违反相关法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。