

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 7 天理财产品 A 款

## 2023 年第 2 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：2023 年 4 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<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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0332      | 728,787,314.85 | 1.0332      | 752,950,656.56 | 0.65%         |
| 2023-03-31 | 1.0265      | 895,131,251.28 | 1.0265      | 918,880,904.44 |               |

### B 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0241      | 175,678,938.45 | 1.0241      | 179,913,776.15 | 0.65%         |
| 2023-03-31 | 1.0175      | 2,908,499.76   | 1.0175      | 2,959,391.93   |               |

### C 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0267      | 50,540,090.45 | 1.0267      | 51,889,272.00 | 0.69%         |
| 2023-03-31 | 1.0197      | 2,448,198.18  | 1.0197      | 2,496,515.24  |               |

### D 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0346      | 161,191,294.95 | 1.0346      | 166,774,055.71 | 0.68%         |
| 2023-03-31 | 1.0276      | 90,712,198.75  | 1.0276      | 93,218,323.32  |               |

### 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0278      | 256,417,464.69 | 1.0278      | 263,537,461.47 | 0.70%         |
| 2023-03-31 | 1.0207      | 188,825,429.26 | 1.0207      | 192,726,051.80 |               |

**M 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0293      | 222,955,452.92 | 1.0293      | 229,480,893.20 | 0.65%         |
| 2023-03-31 | 1.0227      | 277,611,693.08 | 1.0227      | 283,904,914.86 |               |

**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 |
|------------|-------------|------------|-------------|------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0209      | 129,951.51 | 1.0209      | 132,668.33 | 0.65%         |
| 2023-03-31 | 1.0143      | 397,837.39 | 1.0143      | 403,511.61 |               |

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<br>(元)    | 占总资产<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<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 | 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<br>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<br>OTC | 英大资产-聚鑫 8 号<br>保险资管产品  | 买入   | 125,300,000.00 |



#### 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。