

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 30 天理财 产品 A 款

## 2023 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：2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 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
H 份额销售代码	22115005H
M 份额销售代码	22115005M
N 份额销售代码	22115005N
O 份额销售代码	22115005O
X 份额销售代码	22115005X
Z 份额销售代码	22115005Z
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	100.17%
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
2023-09-30	1.0401	338,735,696.83	1.0401	352,321,772.74	0.63%
2023-06-30	1.0336	439,471,961.51	1.0336	454,259,018.09	

### 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
2023-09-30	1.0299	9,898,245.59	1.0299	10,194,255.83	0.62%
2023-06-30	1.0236	9,733,065.27	1.0236	9,962,483.89	

### 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
2023-09-30	1.0371	66,442,942.30	1.0371	68,904,873.99	0.67%
2023-06-30	1.0302	75,992,923.86	1.0302	78,289,798.23	

### 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
2023-09-30	1.0354	711,537,212.69	1.0354	736,701,878.35	0.66%
2023-06-30	1.0286	838,324,253.42	1.0286	862,259,613.39	

### 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
2023-09-30	1.0332	1,699,817,223.00	1.0332	1,756,181,016.22	0.65%
2023-06-30	1.0265	1,931,368,042.94	1.0265	1,982,527,418.09	

**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
2023-09-30	1.0373	1,122,437,109.22	1.0373	1,164,295,463.51	0.66%
2023-06-30	1.0305	1,933,201,567.29	1.0305	1,992,098,691.60	

**N 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
2023-09-30	1.0102	11,104,338.72	1.0102	11,217,313.51	0.68%
2023-06-30	1.0034	10,441,902.09	1.0034	10,477,424.12	

**O 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
2023-09-30	1.0244	863,541,193.42	1.0244	884,626,485.19	0.68%
2023-06-30	1.0175	884,998,775.64	1.0175	900,525,814.35	

**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
2023-09-30	1.0338	31,265,028.88	1.0338	32,321,616.68	0.67%
2023-06-30	1.0269	27,098,798.55	1.0269	27,826,685.79	

**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
2023-09-30	1.0243	2,881,502.36	1.0243	2,951,610.83	0.41%
2023-06-30	1.0201	1,508,717.26	1.0201	1,538,989.63	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值\*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	0.00%	53.44%
2	同业存单	0.00%	2.04%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	4.20%
4	债券	0.00%	37.52%
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%	2.80%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	100.00%	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	他行存款	现金及银行存款	488,612,015.66	9.72%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	351,894,741.05	7.00%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	211,215,572.78	4.20%
4	新华工行佛山定存(2022)1号	现金及银行存款	140,066,408.32	2.79%
5	23恒泰F1	债券	95,486,057.33	1.90%
6	新华工行遵义定存(2022)1号	现金及银行存款	73,751,655.41	1.47%
7	新华交行定存(2020)8号	现金及银行存款	69,169,718.21	1.38%
8	20通融03	债券	55,134,726.73	1.10%
9	20晋产01	债券	53,843,757.41	1.07%
10	新华交行定存(2021)3号	现金及银行存款	51,464,183.09	1.02%

### 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）
首创证券股份有限公司	zc23092105.SZ	庐陵二 2A	33,206,481.74
招商证券股份有限公司	252417.SH	23 恒泰 F1	92,075,455.89

#### 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	150,000,000.00



## 第四章 收益分配情况

除权日期	每万份理财份额分红数（元）
-	-

## 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	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。