

华夏理财固定收益增强最短持有 180 天理财产品 A 款

2023 年第 4 季度报告

重要信息提示：

- 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。
- 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 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 180 天理财产品 A 款
理财产品代码	22135003
A 份额销售代码	22135003A
C 份额销售代码	22135003C
H 份额销售代码	22135003H
V 份额销售代码	22135003V
Y 份额销售代码	22135003Y
Z 份额销售代码	22135003Z
产品登记编码	Z7003922000015
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	111.73%
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
2023-12-31	1.0627	3,007,754,336.10	1.0627	3,196,193,417.42	1.25%
2023-09-30	1.0496	4,040,013,720.09	1.0496	4,240,579,828.13	

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
2023-12-31	1.0422	2,320,330,071.44	1.0422	2,418,216,084.15	1.24%
2023-09-30	1.0294	2,195,496,162.13	1.0294	2,260,109,081.47	

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
2023-12-31	1.0403	1,205,043,525.42	1.0403	1,253,666,908.31	1.26%
2023-09-30	1.0274	2,222,370,000.32	1.0274	2,283,157,182.36	

V 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
2023-12-31	1.0390	77,423,827.85	1.0390	80,443,862.69	1.25%
2023-09-30	1.0262	565,405,020.78	1.0262	580,214,688.84	

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
2023-12-31	1.0423	2,621,917.54	1.0423	2,732,743.97	1.32%
2023-09-30	1.0287	51,997,877.51	1.0287	53,490,716.39	

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
2023-12-31	1.0405	31,255.95	1.0405	32,522.81	1.24%
2023-09-30	1.0278	134,425.07	1.0278	138,167.29	

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	0.35%	20.05%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.43%
4	债券	0.00%	76.06%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	2.16%
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%	1.29%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.65%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	493,248,884.30	6.35%
2	22 青岛银行永续债 02	债券	141,505,828.38	1.82%
3	农行天津滨海分行 20230906/12	现金及银行存款	121,049,714.63	1.56%
4	银华中债 1-3 年国开行债券指数 D	公募基金	100,153,459.76	1.29%
5	建行溧阳嘉丰支行 20231215-35	现金及银行存款	97,259,291.06	1.25%
6	22 建发集 MTN003	债券	94,366,629.20	1.22%
7	民生优 1	权益类投资	91,808,418.30	1.18%
8	农行北京门头沟支行 20230908/8	现金及银行存款	80,687,355.22	1.04%
9	19 上饶 01	债券	78,124,827.90	1.01%
10	22 建发集 MTN002	债券	75,893,059.67	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）
首创证券股份有限公司	253203	23 首创 C2	572,760.60
中国建设银行股份有限公司	360030	建行优 1	1,383,788.26

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）
国信证券股份有限公司	253200	23 赣江 02	162,547.00

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）
-	-	-	-	-

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系最短持有期产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

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

截止本报告日，产品投资的债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。产品持资产仓“H20 远资 1”占比不超过 0.05%，该债券在宽限期 90 天后，经持有人同意展期。由于该债券持仓占比极低，价格波动对产品的影响很小。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，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

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000881336

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。