

# 华夏理财固定收益增强型周周定开理财产品 2 号

## 2023 年第 1 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 01 月 01 日至 2023 年 3 月 31 日

## 第一章 基本信息

|         |                         |
|---------|-------------------------|
| 产品名称    | 华夏理财固定收益增强型周周定开理财产品 2 号 |
| 理财产品代码  | 2119187202              |
| 产品登记编码  | Z7003921000286          |
| 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    | 101.95%                 |
| 产品起始日期  | 2021-06-25              |
| 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

| 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 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2023-03-31 | 1.0608      | 2,734,016,624.61 | 1.0608      | 2,900,198,919.02 | 1.16%         |
| 2022-12-31 | 1.0486      | 2,899,340,311.65 | 1.0486      | 3,040,188,901.79 |               |

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       | 0.28%     | 35.65%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.27%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.03%     | 46.75%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 17.33%    |
| 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%     | 0.00%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.69%    | 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 | 447,545,768.74 | 15.14%      |
| 2  | 21 天恒置业 MTN003              | 权益类投资   | 152,693,802.34 | 5.16%       |
| 3  | 农行台州温岭支行 20(20220610)       | 现金及银行存款 | 123,088,603.70 | 4.16%       |
| 4  | 工行中山银苑支行 9.9(20220728)      | 现金及银行存款 | 121,358,623.44 | 4.10%       |
| 5  | 农业银行逸景翠园支行 20<br>(20230324) | 现金及银行存款 | 120,114,970.63 | 4.06%       |
| 6  | 21 濮阳投资 MTN001              | 债券      | 105,456,861.54 | 3.57%       |
| 7  | 21 浦城 01                    | 债券      | 105,390,367.14 | 3.56%       |
| 8  | 20 中建六局 MTN001              | 权益类投资   | 103,886,020.03 | 3.51%       |
| 9  | 22 中国银行永续债 02               | 权益类投资   | 82,728,226.19  | 2.80%       |
| 10 | 21 常高 01                    | 债券      | 80,830,344.34  | 2.73%       |

### 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）      |
|------------|--------------|---------------|--------------|
| 鲁能集团有限公司   | 136692.SH    | 16 鲁能 02      | 647,788.37   |
| 平安银行股份有限公司 | 112311041.IB | 23 平安银行 CD041 | 1,713,471.93 |

#### 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   | 262,470,000.00 |
| 英大保险资产管理有限公司 | YD-HLYJ<br>OTC | 英大资产活利壹玖<br>资产管理产品     | 买入   | 90,000,000.00  |

## 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**

报告期内无流动性风险事件发生。

### **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，产品投资的债券资产总体资质较优。债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。

#### **5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况**

本产品持有的权益仓位相对保守，价格波动对组合净值波动的影响保持在可控范围内。

#### **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 | 10257000000866883 |

## **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。