

华夏理财固定收益纯债最短持有 90 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 90 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115001
A 份额销售代码	22115001A
B 份额销售代码	22115001B
C 份额销售代码	22115001C
M 份额销售代码	22115001M
产品登记编码	Z7003922000010
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	105.12%
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	1.0407	1,986,352,375.42	1.0407	2,067,168,220.33	0.88%
2023-03-31	1.0316	1,376,420,890.88	1.0316	1,419,952,729.02	

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	1.0350	85,045,266.29	1.0350	88,023,147.28	0.88%
2023-03-31	1.0260	59,941,678.17	1.0260	61,500,726.23	

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	1.0307	180,544,083.59	1.0307	186,094,242.78	0.91%
2023-03-31	1.0214	72,497,363.57	1.0214	74,047,953.26	

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	1.0288	1,184,463,147.13	1.0288	1,218,568,570.03	0.88%
2023-03-31	1.0198	10,517,718.39	1.0198	10,726,267.29	

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	1.31%	49.73%
2	同业存单	0.00%	0.22%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.07%
4	债券	0.00%	49.78%
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%	0.21%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.69%	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 (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	257,285,657.76	6.88%
2	农行台州温岭支行 20(20220610)	现金及银行存款	78,505,407.66	2.10%
3	工行中山银苑支行 9.9(20220728)	现金及银行存款	77,404,459.23	2.07%
4	农业银行逸景翠园支行 20 (20230324)	现金及银行存款	76,634,973.14	2.05%
5	建设银行秦皇岛港口专业支行 202305125604	现金及银行存款	42,023,121.62	1.12%
6	建设银行秦皇岛港口专业支行 202305125605	现金及银行存款	42,023,121.62	1.12%
7	光大银行福州分行 202305197464	现金及银行存款	41,994,260.37	1.12%
8	光大银行福州分行 202305197465	现金及银行存款	41,994,260.37	1.12%
9	光大银行福州分行 202305197466	现金及银行存款	41,994,260.37	1.12%
10	光大银行福州分行 202305197467	现金及银行存款	41,994,260.37	1.12%

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	20,000,000.00
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	13,000,000.00
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	140,000,000.00
英大基金管理有限公司	650956 OTC	英大基金-华英稳健 5 号集合资产管理计 划	买入	150,000,000.00
英大基金管理有限公司	ydhywj01 OTC	英大基金-华英稳健 1 号集合资产管理计 划	买入	20,000,000.00
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	133,000,000.00

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

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,产品投资的债券资产总体资质较优,但持仓中部分资产信用评级展望有所调整。其中,20 双龙 03 (177498.SH) 发行人贵州双龙航空港开发投资(集团)有限公司 2023 年 6 月信用评级展望被中诚信国际信用评级有限责任公司调整为负面,本债券由贵州省国有资本运营有限责任公司提供担保增信。20 远资 01 (175093.SH) 发行人远洋资本有限公司 2023 年 4 月主体信用评级被中诚信国际信用评级有限责任公司由 AA+调低至 AA,评级展望调整为负面,2023 年 6 月主体信用评级被中诚信国际信用评级有限责任公司 AA 调低至 A+,评级展望维持负面。

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优。根据公司理财资产风险分类的要求,持仓中 PR01 优(代码 169741.SH)的资产风险分类为关注类,本债券的原始权益人/差额支付人/售回和回购承诺人其他公开债务存在展期的情形。该券在产品持仓中占比不高于 0.1%,对产品净值影响较小。根据公司理财资产风险分类的要求,持仓中 20 远资 01 (代码 175093.SH)的资产风险分类为

关注类，本债券发行人其他公开债务存在展期的情形。该券在产品持仓中占比不高于 0.1%，对产品净值影响较小。

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	10257000000881085

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。