

华夏理财固定收益增强周期 180 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	华夏理财固定收益增强周期 180 天理财产品 A 款
理财产品代码	2119187001
A 份额销售代码	2119187001
S 份额销售代码	2119187001S
产品登记编码	Z7003921000275
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	121.14%
产品起始日期	2021-06-23
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	1.0673	3,596,716,496.34	1.0673	3,838,625,696.15	0.95%
2023-03-31	1.0573	4,749,920,833.99	1.0573	5,021,986,882.93	

S 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	1.0139	70,096,573.67	1.0139	71,067,648.54	0.99%
2023-03-31	1.0040	55,172,076.90	1.0040	55,392,606.85	

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	0.23%	11.94%
2	同业存单	0.00%	0.98%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.55%
4	债券	1.08%	73.02%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	10.88%
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	0.12%	2.62%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.57%	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	565,484,860.52	11.94%
2	20 连城 Y1	权益类投资	106,794,003.00	2.25%
3	22 河钢集 MTN001	债券	52,458,639.78	1.11%
4	22 河北银行永续债	权益类投资	48,341,108.90	1.02%
5	20 济高 Y2	权益类投资	46,856,673.75	0.99%
6	民生优 1	权益类投资	38,753,228.60	0.82%
7	21 华租 03	债券	38,612,636.33	0.82%
8	22 周投 01	债券	38,376,397.52	0.81%
9	22 宁波银行二级资本债 01	债券	34,355,258.87	0.73%
10	22 衡阳 03	债券	31,429,529.85	0.66%

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）
兴业银行股份有限公司	222380003.IB	23 兴业银行绿债 01	3,342,344.30

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）
英大基金管理 有限公司	ydhywj02 OTC	英大基金-华英稳健 2号集合资产管理计 划	买入	410,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19RE OTC	中诚信托嘉信 12 号 集合资金信托计划	买入	4,500,000.00

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

流动性风险管理方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金、正逆回购及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是产品持有一定比例的高流动性资产，赎回期内主要通过正回购操作或卖出部分资产变现，满足产品的流动性需求。

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，但持仓中部分资产主体信用评级有所调整。其中，20 时代 10（167340.SH）发行人广州市时代控股集团有限公司 2023 年 6 月主体信用评级被上海新世纪资信评估投资服务有限公司由 AA+调低为 AA-；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。同时，根据公司理财资产风险分类的要求，持仓中 20 时代 10（167340.SH）、20 远资 01（175093.SH）、PR01 优（代码 169741.SH）、PR 龙债 02（代码 166599.SH）的资产风险分类为关注类，该券在产品持仓中占比均不高于 0.05%，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，产品投资的权益资产价格波动对组合净值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

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	10257000000866226

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。