

华夏理财固定收益增强最短持有 60 天理财 产品 A 款

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最短持有 60 天理财产品 A 款
理财产品代码	22135001
A 份额销售代码	22135001A
H 份额销售代码	22135001H
产品登记编码	Z7003922000013
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	126.53%
产品起始日期	2022-03-22
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

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
2023-03-31	1.0307	2,106,475,124.68	1.0307	2,171,094,075.15	1.67%
2022-12-31	1.0138	2,056,739,172.42	1.0138	2,085,061,988.67	

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
2023-03-31	1.0198	1,356,735,845.24	1.0198	1,383,607,333.56	1.72%
2022-12-31	1.0026	595,723,098.15	1.0026	597,296,519.97	

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	1.87%	15.95%
2	同业存单	0.00%	1.30%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.14%
4	债券	0.00%	67.74%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	10.84%
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	3.66%	4.03%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	94.48%	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	717,211,852.75	15.95%
2	易方达年年恒夏纯债一年定开 A	公募基金	59,293,535.92	1.32%
3	上银优 1	权益类投资	44,960,121.61	1.00%
4	杭银优 1	权益类投资	40,935,994.40	0.91%
5	长银优 1	权益类投资	32,047,656.90	0.71%
6	创金合信恒利超短债 A	公募基金	30,001,764.89	0.67%
7	广发景明中短债 A	公募基金	29,999,900.00	0.67%
8	22 中海企业 MTN004	债券	29,889,918.05	0.66%
9	20 赣版 01	债券	29,590,468.96	0.66%
10	19 北汽 06	债券	29,460,783.11	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）
鲁能集团有限公司	136692.SH	16 鲁能 02	418,083.24
平安银行股份有限公司	112311041.IB	23 平安银行 CD041	1,886,139.14

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	YD-HLYJ OTC	英大资产活利壹玖 资产管理产品	买入	263,000,000.00
英大基金管理有限公司	650957 OTC	英大基金-华英稳健 6号集合资产管理计 划	买入	67,000,000.00

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。根据公司理财资产风险分类的要求，持仓中 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

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	10257000000881314

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。