

华夏理财固定收益纯债最短持有 14 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 14 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115004
A 份额销售代码	22115004A
B 份额销售代码	22115004B
C 份额销售代码	22115004C
H 份额销售代码	22115004H
M 份额销售代码	22115004M
N 份额销售代码	22115004N
Z 份额销售代码	22115004Z
产品登记编码	Z7003922000024
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	107.61%
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	1.0304	394,042,799.02	1.0304	406,027,385.38	0.71%
2023-03-31	1.0231	569,441,393.14	1.0231	582,600,511.54	

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	1.0183	39,873,568.98	1.0183	40,603,120.24	0.71%
2023-03-31	1.0111	22,871,360.67	1.0111	23,124,560.85	

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	1.0216	709,502,299.13	1.0216	724,854,550.17	0.75%
2023-03-31	1.0140	590,463,562.67	1.0140	598,730,895.50	

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
2023-06-30	1.0225	602,741,991.97	1.0225	616,306,283.01	0.77%
2023-03-31	1.0147	886,224,203.75	1.0147	899,287,227.12	

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	1.0202	92,552,465.98	1.0202	94,425,001.98	0.71%
2023-03-31	1.0130	135,781,694.42	1.0130	137,546,450.61	

N 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	1.0224	12,559,660.78	1.0224	12,841,618.12	0.76%
2023-03-31	1.0147	37,627,888.06	1.0147	38,179,478.32	

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
2023-06-30	1.0114	124,396.91	1.0114	125,818.16	0.71%
2023-03-31	1.0043	183,095.27	1.0043	183,874.92	

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	8.41%	42.34%
2	同业存单	0.00%	6.02%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	9.82%
4	债券	0.00%	38.97%
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	2.60%	2.85%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	88.99%	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	302,221,774.97	14.82%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	200,194,637.69	9.82%
3	22 北京银行 CD153	同业存单	99,286,379.13	4.87%
4	22 南安 D1	债券	71,293,142.52	3.50%
5	创金合信恒利超短债 A	公募基金	49,631,055.93	2.43%
6	农行泰州姜堰支行	现金及银行存款	29,188,725.59	1.43%
7	工行望城支行 3	现金及银行存款	29,076,848.89	1.43%
8	福州南门支行 1	现金及银行存款	23,396,638.11	1.15%
9	福州南门支行 3	现金及银行存款	23,396,638.11	1.15%
10	福州南门支行 4	现金及银行存款	23,396,638.11	1.15%

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	100,000,000.00

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。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 0.05%,对产品净值影响较小。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 0.02%,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	10257000000881052

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。