

华夏理财固定收益增强型一年定开理财产品 2 号

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型一年定开理财产品 2 号
理财产品代码	211918700302
产品登记编码	Z7003921000014
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	125.04%
产品起始日期	2021-08-25
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 (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	1.0600	140,175,033.86	1.0600	148,586,126.89	1.00%
2023-03-31	1.0495	140,175,033.86	1.0495	147,117,409.12	

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	2.72%	2.38%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.32%
4	债券	0.00%	74.34%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	17.67%
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%	5.29%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	97.28%	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	21 拱墅 03	债券	5,513,938.91	2.97%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	4,424,559.02	2.38%
3	民生优 1	权益类投资	3,864,324.94	2.08%
4	易方达恒久 1 年定期债券 A	公募基金	2,768,568.71	1.49%
5	21 德邦 C1	债券	2,764,695.89	1.49%
6	中欧短债 A	公募基金	2,690,722.13	1.45%
7	20 奉投 01	债券	2,689,847.48	1.45%
8	19 农业银行永续债 01	权益类投资	2,518,419.43	1.36%
9	22 青岛银行永续债 02	权益类投资	2,455,587.98	1.32%
10	富国短债 A	公募基金	2,444,143.07	1.32%

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）
-	-	-	-	-

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

本产品在二季度未开放，持仓中有一定比例的高流动性资产，能够满足临时赎回的需要，流动性风险较低。

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。根据公司理财产品风险分类的要求，持仓中 PR01 优（代码 169741.SH）、20 远资 01（175093.SH）、PR 龙债 02（166599.SH）的资产风险分类为关注类。同时，PR01 优（代码 169741.SH）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，20 远资 01（175093.SH）债券发行人其他公开债务存在展期的情形。20 远资 01（175093.SH）发行人远洋资本有限公司 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。这几只债券在产品持仓中占比均不高于 0.3%，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

产品投资的权益类资产均为永续债和优先股，风险可控，二季度价格震荡上行，对组合有正收益贡献。

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	10257000000857143

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。