

华夏理财固定收益增强型一年定开理财产品 2 号

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	134.95%
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
2023-03-31	1.0495	140,175,033.86	1.0495	147,117,409.12	1.70%
2022-12-31	1.0320	140,175,033.86	1.0320	144,662,546.11	

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	4.77%	5.37%
2	同业存单	0.00%	1.96%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	79.40%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	11.46%
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%	1.81%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	95.23%	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	10,654,588.98	5.37%
2	21 拱墅 03	债券	5,942,259.79	2.99%
3	20 仪征 02	债券	4,476,277.86	2.25%
4	21 德邦 C1	债券	3,011,387.76	1.52%
5	易方达恒久 1 年定期债券 A	公募基金	2,990,004.23	1.51%
6	22 联优 02	债券	2,863,348.93	1.44%
7	21 火炬 02	债券	2,395,082.52	1.21%
8	21 徐州新盛 PPN003	债券	2,365,036.82	1.19%
9	21 平证 Y1	权益类投资	2,291,478.81	1.15%
10	21 鲁黄金 MTN002	债券	2,231,369.13	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）
-	-	-	-	-

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

本产品报告期内未开放，持有 5% 以上的现金等高流动性资产，可以应对封闭期内的临时赎回，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

本产品持有超过 80% 的同业存单和纯债，以及 2% 左右的纯债基金，均为中高等级，信用风险可控，估值净价大幅波动的风险较低。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品持有 11% 以上的权益类资产，主要为优先股和永续债，存在一定的市场风险，估值净价可能随市场波动。

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。