

华夏理财固定收益增强最短持有 270 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 270 天理财产品 A 款
理财产品代码	22135007
A 份额销售代码	22135007A
产品登记编码	Z7003922000022
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	115.28%
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

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	1.0269	1,286,018,016.33	1.0269	1,320,610,392.73	1.70%
2022-12-31	1.0097	1,584,613,836.48	1.0097	1,600,013,892.57	

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	3.10%	9.56%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.11%
4	债券	0.00%	74.36%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	14.75%
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%	1.22%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	96.90%	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	145,568,644.57	9.56%
2	22 光穗建发 ABN002 优先	债券	46,208,306.52	3.04%
3	22 济南高新 MTN001	权益类投资	36,789,686.45	2.42%
4	22 蛇口 02	债券	28,782,401.24	1.89%
5	22 淮建 01	债券	26,353,785.35	1.73%
6	22 经开投	债券	24,422,592.06	1.60%
7	21 拱墅 03	债券	22,781,346.84	1.50%
8	21 深担 01	债券	22,665,878.57	1.49%
9	22 创投 01	债券	21,475,802.89	1.41%
10	22 衡阳 03	债券	20,818,645.54	1.37%

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）
中国建设银行股份有限公司	112305039.IB	23 建设银行 CD039	1,061,871.63

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	650952 OTC	英大基金-华英稳健3号集合资产管理计划	买入	50,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC19KZ OTC	中诚信托嘉信配置1号集合资金信托计划	买入	18,873,260.00
中诚信托有限责任公司	ZC19L1 OTC	中诚信托嘉信配置2号集合资金信托计划	买入	5,479,500.00
中诚信托有限责任公司	ZC1A3M OTC	中诚信托汇鑫16号集合资金信托计划	买入	70,600,000.00

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

本产品每日开放，本报告期内赎回顺利。截至本报告日，产品持有 9%以上的现金等高流动性资产，能够满足每日赎回的需要，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。根据公司内部理财风险资产分类的认定，持仓中 PR01 优（169741.SH）、PR 龙债 02（代码 166599.SH）和 20 远资 01（175093.SH）的资产风险认定从正常类划分为关注类，该券在产品持仓中占比分别不高于 0.4%、0.1%和 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

本产品持有 14%以上的权益类资产，主要为优先股和永续债，以及少量的权益类公募基金，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	10257000000881347

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。