

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 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	华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 2 号
理财产品代码	21121002
A 份额销售代码	21121002A
B 份额销售代码	21121002B
C 份额销售代码	21121002C
D 份额销售代码	21121002D
F 份额销售代码	21121002F
J 份额销售代码	21121002J
产品登记编码	Z7003921000308
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式
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	120.96%
产品起始日期	2022-06-23
产品终止日期	2023-07-18

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	1.0270	223,760,985.00	1.0270	229,806,878.12	1.93%
2022-12-31	1.0076	223,760,985.00	1.0076	225,466,683.28	

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
2023-03-31	1.0270	260,375,486.00	1.0270	267,410,681.74	1.93%
2022-12-31	1.0076	260,375,486.00	1.0076	262,360,291.40	

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
2023-03-31	1.0258	211,542,483.00	1.0258	217,007,518.63	1.89%
2022-12-31	1.0068	211,542,483.00	1.0068	212,987,801.14	

D 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	1.0250	520,036,529.00	1.0250	533,060,763.30	1.86%
2022-12-31	1.0063	520,036,529.00	1.0063	523,315,658.93	

F 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	1.0266	13,880,658.00	1.0266	14,250,219.49	1.91%
2022-12-31	1.0074	13,880,658.00	1.0074	13,982,809.40	

J 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	1.0270	528,100,738.00	1.0270	542,369,716.00	1.93%
2022-12-31	1.0076	528,100,738.00	1.0076	532,126,374.97	

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	0.12%	0.37%
2	同业存单	0.00%	0.13%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	66.89%
5	非标准化债权类资产	39.34%	32.58%
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	0.00%	0.03%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	60.54%	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	厦门信托.嵊州市交通投资发展集团有限公司理财融资项目	非标准化债权类资产	510,674,738.81	23.40%
2	粤财信托.海安开发区建设投资有限公司理财投融资项目(瑞丰 38 号)717 到期	非标准化债权类资产	200,225,853.71	9.18%
3	21 华租 03	债券	12,086,706.61	0.55%
4	20 电建 A	债券	11,554,908.14	0.53%
5	20 电建 01	债券	11,259,399.78	0.52%
6	22 河钢集 MTN001	债券	10,767,944.94	0.49%
7	20 京供销 MTN001	债券	10,059,255.34	0.46%
8	21 泛悦优	债券	10,053,232.11	0.46%
9	20 桂交 01	债券	9,896,486.37	0.45%
10	22 绿城地产 MTN005	债券	9,664,358.10	0.44%

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
1	嵊州市交通投资发展集团有限公司	厦门信托.嵊州市交通投资发展集团有限公司理财融资项目	信托贷款	5.11	91	正常
2	海安开发区建设投资有限公司	粤财信托.海安开发区建设投资有限公司理财投融资项目(瑞丰 38 号)717 到期	信托贷款	4.62	108	正常

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）
招商证券股份有限公司	032380258.IB	23 常德城投 PPN004	1,555,151.22

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

本产品投资的资管计划底层资产为债券资产，将根据产品到期时间，做好流动性管理。

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 20 时代 10（代码 167340.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 0.055%，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

无持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000870979

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。