

华夏理财固定收益纯债最短持有 30 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 30 天理财产品 A 款
理财产品代码	22115005
A 份额销售代码	22115005A
B 份额销售代码	22115005B
C 份额销售代码	22115005C
D 份额销售代码	22115005D
H 份额销售代码	22115005H
M 份额销售代码	22115005M
N 份额销售代码	22115005N
O 份额销售代码	22115005O
X 份额销售代码	22115005X
Z 份额销售代码	22115005Z
产品登记编码	Z7003922000025
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	105.45%
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	1.0336	439,471,961.51	1.0336	454,259,018.09	0.74%
2023-03-31	1.0260	546,196,941.00	1.0260	560,406,268.16	

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	1.0236	9,733,065.27	1.0236	9,962,483.89	0.75%
2023-03-31	1.0160	30,577,470.32	1.0160	31,067,087.84	

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	1.0302	75,992,923.86	1.0302	78,289,798.23	0.78%
2023-03-31	1.0222	86,012,401.12	1.0222	87,923,719.18	

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
2023-06-30	1.0286	838,324,253.42	1.0286	862,259,613.39	0.78%
2023-03-31	1.0206	981,077,861.74	1.0206	1,001,258,233.94	

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	1.0265	1,931,368,042.94	1.0265	1,982,527,418.09	0.78%
2023-03-31	1.0186	1,769,352,139.81	1.0186	1,802,345,578.86	

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	1.0305	1,933,201,567.29	1.0305	1,992,098,691.60	0.78%
2023-03-31	1.0225	825,644,521.02	1.0225	844,191,294.91	

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	1.0034	10,441,902.09	1.0034	10,477,424.12	0.34%
2023-05-16	1.0000	-	1.0000	-	

O 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	1.0175	884,998,775.64	1.0175	900,525,814.35	0.79%
2023-03-31	1.0095	17,562,615.79	1.0095	17,729,925.69	

X 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	1.0269	27,098,798.55	1.0269	27,826,685.79	0.80%
2023-03-31	1.0188	15,074,671.80	1.0188	15,357,550.96	

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	1.0201	1,508,717.26	1.0201	1,538,989.63	1.09%
2023-03-31	1.0091	173,060.77	1.0091	174,639.79	

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	1.37%	40.36%
2	同业存单	0.00%	3.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.79%
4	债券	0.00%	46.13%
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	6.15%	7.72%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	92.47%	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	740,620,884.45	11.11%
2	他行存款	现金及银行存款	484,804,938.91	7.27%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	185,740,908.16	2.79%
4	新华工行佛山定存(2022)1号	现金及银行存款	118,551,291.62	1.78%
5	创金合信恒利超短债 A	公募基金	108,859,029.38	1.63%
6	创金合信恒兴中短债 A	公募基金	100,240,830.89	1.50%
7	新华交行定存(2020)8号	现金及银行存款	92,621,567.16	1.39%
8	新华工行遵义定存(2022)1号	现金及银行存款	66,525,247.12	1.00%
9	新华建行东莞市分行1号	现金及银行存款	61,674,539.61	0.93%
10	新华广州定存(2021)1号	现金及银行存款	60,468,845.79	0.91%

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	420,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19RI OTC	中诚信托汇鑫 12 号 集合资金信托计划	买入	250,000,000.00

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	10257000000881063

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。