

# 华夏理财固定收益纯债最短持有 180 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 180 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码   | 22115002                     |
| A 份额销售代码 | 22115002A                    |
| B 份额销售代码 | 22115002B                    |
| M 份额销售代码 | 22115002M                    |
| N 份额销售代码 | 22115002N                    |
| V 份额销售代码 | 22115002V                    |
| Z 份额销售代码 | 22115002Z                    |
| 产品登记编码   | Z7003922000011               |
| 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     | 125.61%                      |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)         | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)         | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0411      | 1,492,660,974.29 | 1.0411      | 1,554,065,229.95 | 1.00%         |
| 2023-03-31 | 1.0308      | 1,395,104,919.28 | 1.0308      | 1,438,081,896.19 |               |

### B 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0351      | 20,212,953.26 | 1.0351      | 20,922,937.15 | 1.00%         |
| 2023-03-31 | 1.0249      | 37,555,632.98 | 1.0249      | 38,489,258.89 |               |

### M 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)         | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)         | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0292      | 1,270,927,898.15 | 1.0292      | 1,308,007,076.47 | 1.01%         |
| 2023-03-31 | 1.0189      | 136,062,118.01   | 1.0189      | 138,639,751.89   |               |

### N 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0313      | 19,967,610.73 | 1.0313      | 20,593,295.78 | 1.05%         |
| 2023-03-31 | 1.0206      | 11,388,921.08 | 1.0206      | 11,623,270.69 |               |

### V 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)         | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)         | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0191      | 319,734,939.56   | 1.0191      | 325,844,047.84   | 1.03%         |
| 2023-03-31 | 1.0087      | 2,507,062,806.88 | 1.0087      | 2,528,953,058.55 |               |

## Z 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0260      | 59,900,990.10 | 1.0260      | 61,457,295.42 | 1.08%         |
| 2023-03-31 | 1.0150      | 59,900,990.10 | 1.0150      | 60,802,013.58 |               |

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       | 2.20%     | 14.98%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.05%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.59%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 83.37%    |
| 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          | 0.00%     | 1.01%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 97.80%    | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------|---------|----------------|-------------|
| 1  | 存款及清算款等现金类资产   | 现金及银行存款 | 200,242,403.33 | 4.84%       |
| 2  | 20 融盛 02       | 债券      | 112,878,301.23 | 2.73%       |
| 3  | 21 滨江城建 PPN001 | 债券      | 72,746,271.17  | 1.76%       |
| 4  | 20 襄置 02       | 债券      | 62,194,277.72  | 1.50%       |
| 5  | 20 郴投集团 PPN003 | 债券      | 59,775,415.27  | 1.45%       |
| 6  | 21 青岛银行二级 02   | 债券      | 42,099,446.91  | 1.02%       |
| 7  | 汇添富长添利定期开放债券 A | 公募基金    | 41,769,720.11  | 1.01%       |
| 8  | 22 威海 03       | 债券      | 41,139,824.88  | 1.00%       |
| 9  | 20 炜赋 01       | 债券      | 33,872,472.88  | 0.82%       |
| 10 | 22 荆发 02       | 债券      | 33,105,445.31  | 0.80%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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）      |
|------------|-----------|----------|--------------|
| 招商证券股份有限公司 | 251403.SH | 23 铜建 06 | 4,661,606.04 |

#### 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）        |
|----------------|-----------------|------------------------------|------|----------------|
| 英大保险资产管理有限公司   | 601082 OTC      | 英大资产-聚鑫 11 号<br>保险资管产品       | 买入   | 50,000,000.00  |
| 英大基金管理有限公司     | 650956 OTC      | 英大基金-华英稳健<br>5 号集合资产管理计<br>划 | 买入   | 406,000,000.00 |
| 英大基金管理有限公司     | ydhywj01<br>OTC | 英大基金-华英稳健<br>1 号集合资产管理计<br>划 | 买入   | 5,000,000.00   |
| 中诚信托有<br>限责任公司 | ZC19RI OTC      | 中诚信托汇鑫 12 号<br>集合资金信托计划      | 买入   | 80,000,000.00  |

#### 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。

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 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 0.1%,对产品净值影响较小。根据公司理财资产风险分类的要求,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 0.1%，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 | 10257000000881212 |

## **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。