

华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财 产品 26 号

2023 年第 3 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 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财产品 26 号
理财产品代码	23151026
A 份额销售代码	23151026A
B 份额销售代码	23151026B
X 份额销售代码	23151026X
产品登记编码	Z7003923000163
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	106.91%
产品起始日期	2023-05-16
产品终止日期	2024-08-06

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
2023-09-30	1.0151	232,409,439.00	1.0151	235,925,204.96	1.09%
2023-06-30	1.0042	232,409,439.00	1.0042	233,392,979.25	

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
2023-09-30	1.0149	451,422.00	1.0149	458,164.84	1.07%
2023-06-30	1.0042	451,422.00	1.0042	453,304.47	

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
2023-09-30	1.0155	127,937,765.00	1.0155	129,921,889.27	1.11%
2023-06-30	1.0044	127,937,765.00	1.0044	128,495,028.03	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值*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	2.12%	2.17%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.34%
4	债券	7.66%	57.39%
5	非标准化债权类资产	42.57%	39.87%
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%	0.23%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	47.65%	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	中信信托·青岛城市建设投资理财融资项目·华信 11.0806 到期	非标准化债权类资产	156,121,919.55	39.87%
2	22 萍乡 04	债券	10,097,489.14	2.58%
3	22 信诚 01	债券	10,028,686.56	2.56%
4	21 水集 01	债券	9,599,708.40	2.45%
5	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	8,503,163.56	2.17%
6	21 贵控 01	债券	6,176,369.11	1.58%
7	19 金水 02	债券	5,947,739.10	1.52%
8	22 上饶创新 MTN002	债券	4,911,041.56	1.25%
9	22 金茂 03	债券	4,692,222.30	1.20%
10	22 市北建投 PPN001	债券	3,346,752.98	0.85%

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	青岛城市建设投资(集团)有限责任公司	中信信托.青岛城市建设投资理财融资项目.华信 11.0806 到期	信托贷款	4.5400	311	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）
-	-	-	-

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	每万份理财份额分红数（元）
-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对可能出现的流动性风险。

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。产品组合久期控制在合理范围内，债券资产价格波动对组合净值影响保持在可控范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品持有权益类公募基金仓位价格波动对组合净值波动率的影响保持在可控范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品仓位。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10250000003367051

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。