

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 6 号

## 2022 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：2022 年 01 月 01 日至 2022 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型封闭式理财产品 6 号
理财产品代码	21131006
A 份额销售代码	21131006A
B 份额销售代码	21131006B
C 份额销售代码	21131006C
产品登记编码	Z7003921000395
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	128.39%
产品起始日期	2021-12-16
产品终止日期	2022-06-28

## 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
2022-03-31	1.0100	441,361,408.00	1.0100	445,758,716.44	0.85%
2021-12-31	1.0015	441,361,408.00	1.0015	442,036,711.46	

### 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
2022-03-31	1.0103	395,031,023.00	1.0103	399,081,515.96	0.87%
2021-12-31	1.0016	395,031,023.00	1.0016	395,651,696.44	

### 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
2022-03-31	1.0105	388,575.00	1.0105	392,672.62	0.89%
2021-12-31	1.0016	388,575.00	1.0016	389,201.53	

## 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	1.19%	1.61%
2	同业存单	0.00%	3.58%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.28%
4	债券	0.00%	92.32%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	1.10%
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%	1.11%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.81%	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。

### 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	现金及银行存款	现金及银行存款	17,465,331.31	1.61%
2	19 民生银行永续债	债券	13,776,619.49	1.27%
3	18 国开 06	债券	11,625,810.29	1.07%
4	19 兴港 02	债券	10,273,745.43	0.95%
5	19 广发银行永续债	债券	9,452,964.21	0.87%
6	平银优 01	权益类投资	8,445,527.34	0.78%
7	21 青岛银行二级 02	债券	8,439,957.14	0.78%
8	20 新会 01	债券	7,391,727.36	0.68%
9	21 付息国债 11	债券	6,890,657.72	0.63%
10	21 光大控股 MTN001	债券	6,420,754.71	0.59%

### 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	买入规模（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	买入规模（元）
华夏银行股份有限公司	032280174.IB	22 中山火炬 PPN001	354,574.83
华夏银行股份有限公司	032280323.IB	22 新疆兵团 PPN001	325,182.20
华夏银行股份有限公司	102280104.IB	22 宜春创业 MTN001	146,866.23
华夏银行股份有限公司	102280116.IB	22 新郑投资 MTN001	61,255.69

#### 3.4.3 报告期内其他重大关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	交易金额（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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。

### 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

截止本报告日，产品投资的债券资产外部评级未出现下调，展望稳定，债券价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的权益类资产多为公募基金及优先股。其中公募基金估值随市场变化有所波动，优先股估值较为稳定。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

## 第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000866306

## 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。