

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 28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	华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 28 号
理财产品代码	22131028
A 份额销售代码	22131028A
B 份额销售代码	22131028B
F 份额销售代码	22131028F
产品登记编码	Z7003922000029
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	138.90%
产品起始日期	2022-09-23
产品终止日期	2023-07-05

## 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	1.0084	462,775,829.00	1.0084	466,658,125.05	2.00%
2022-12-31	0.9886	462,775,829.00	0.9886	457,497,036.21	

### 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	1.0089	250,900,796.00	1.0089	253,136,676.74	2.02%
2022-12-31	0.9889	250,900,796.00	0.9889	248,106,112.89	

### 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	1.0092	2,170,400.00	1.0092	2,190,308.37	2.04%
2022-12-31	0.9890	2,170,400.00	0.9890	2,146,516.01	

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	0.16%	0.57%
2	同业存单	0.00%	3.46%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.04%
4	债券	0.00%	82.76%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	7.99%
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	1.45%	4.19%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.39%	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	民生优 1	权益类投资	18,003,909.90	1.80%
2	19 农业银行永续债 01	权益类投资	11,790,329.80	1.18%
3	华夏上证 50ETF 联接 C	公募基金	10,465,386.85	1.04%
4	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	10,415,856.67	1.04%
5	19 广发银行永续债	权益类投资	9,357,919.84	0.93%
6	21 青岛银行二级	债券	9,187,405.04	0.92%
7	21 建设银行二级 01	债券	8,864,954.21	0.88%
8	20 株国 06	债券	8,429,458.22	0.84%
9	22 海恒 K2	债券	7,448,283.42	0.74%
10	21 渤海银行二级	债券	7,348,083.36	0.73%

### 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）
-	-	-	-	-

## 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。本产品系封闭式产品，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 PR 龙债 02（代码 166599.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 0.1%，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，产品投资的权益资产价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 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	10257000000882318

## 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。