

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 60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 60 号
理财产品代码	22131060
A 份额销售代码	22131060A
B 份额销售代码	22131060B
C 份额销售代码	22131060C
D 份额销售代码	22131060D
E 份额销售代码	22131060E
F 份额销售代码	22131060F
产品登记编码	Z7003922000054
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	118.06%
产品起始日期	2022-06-15
产品终止日期	2023-07-11

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	1.0262	135,490,053.00	1.0262	139,037,195.58	1.91%
2022-12-31	1.0070	135,490,053.00	1.0070	136,432,175.54	

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	1.0262	278,252,601.00	1.0262	285,537,281.04	1.91%
2022-12-31	1.0070	278,252,601.00	1.0070	280,187,415.28	

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
2023-03-31	1.0250	45,286,525.00	1.0250	46,416,974.68	1.88%
2022-12-31	1.0061	45,286,525.00	1.0061	45,564,145.65	

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
2023-03-31	1.0242	290,052,324.00	1.0242	297,057,379.39	1.85%
2022-12-31	1.0056	290,052,324.00	1.0056	291,671,376.45	

E 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	1.0262	145,410,114.00	1.0262	149,216,964.99	1.91%
2022-12-31	1.0070	145,410,114.00	1.0070	146,421,215.44	

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	1.0258	2,979,000.00	1.0258	3,055,780.57	1.90%
2022-12-31	1.0067	2,979,000.00	1.0067	2,998,896.77	

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	1.91%	1.99%
2	同业存单	0.00%	0.25%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.08%
4	债券	0.00%	53.13%
5	非标准化债权类资产	38.55%	32.71%
6	权益类投资	0.00%	11.78%
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%	0.06%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	59.54%	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	粤财信托.成都香投集合资金信托计划	非标准化债权类资产	125,176,544.92	11.52%
2	温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年度第六期债权融资计划	非标准化债权类资产	100,018,654.47	9.21%
3	粤财信托.江苏润城城市投资控股集团有限公司(瑞丰 40)710 到期	非标准化债权类资产	70,086,511.71	6.45%
4	粤财信托.海安开发区建设投资有限公司理财投融资项目(瑞丰 38 号)710 到期	非标准化债权类资产	60,068,837.64	5.53%
5	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	21,596,404.18	1.99%
6	22 建发集 MTN002	权益类投资	14,176,378.36	1.30%
7	22 首股 04	债券	14,012,961.78	1.29%
8	20 电建 01	债券	11,297,119.73	1.04%
9	22 津辰 03	债券	11,177,297.16	1.03%
10	交行优 1	权益类投资	10,396,398.62	0.96%

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	成都香城投资集团有限公司	粤财信托.成都香投集合资金信托计划	信托贷款	5.35	85	正常
2	温州市鹿城区国有控股集团有限公司	温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年度第六期债权融资计划	债权融资计划	5.13	90	正常
3	江苏润城城市投资控股集团有限公司	粤财信托.江苏润城城市投资控股集团有限公司(瑞丰 40)710 到期	信托贷款	4.91	101	正常
4	海安开发区建设投资有限公司	粤财信托.海安开发区建设投资有限公司理财投融资项目(瑞丰 38 号)710 到期	信托贷款	4.62	101	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

由于产品为封闭式产品，确保在产品到期时均将持仓资产变现，投资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。根据公司理财资产风险分类的要求，持仓中 20 时代 10（代码 167340.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 0.03%，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

截止本报告日，产品持有的权益仓位价格波动对组合净值波动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

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	10257000000888309

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。