

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 64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封闭式理财产品 64 号
理财产品代码	22131064
产品登记编码	Z7003922000071
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	110.28%
产品起始日期	2022-09-09
产品终止日期	2024-10-15

第二章 净值、存续规模及收益表现

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	1.0205	545,697,394.00	1.0365	556,886,011.40	0.83%
2023-06-30	1.0200	546,097,394.00	1.0280	557,028,479.67	

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	0.91%	1.02%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.37%
4	债券	0.00%	54.78%
5	非标准化债权类资产	43.69%	39.76%
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	3.67%	4.08%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	51.73%	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	百瑞信托·淄博生态产业新城投资发展集团有限公司理财融资项目(百瑞富诚 906 号)	非标准化债权类资产	150,164,487.69	24.45%
2	亳州文化旅游控股集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	93,190,693.60	15.17%
3	19 金水 02	债券	10,028,832.23	1.63%
4	22 金茂 03	债券	7,911,831.61	1.29%
5	22 瓯江 01	债券	7,759,469.92	1.26%
6	易方达深证 100ETF 联接 C	公募基金	6,639,434.18	1.08%
7	21 渤海银行二级	债券	6,359,345.46	1.04%
8	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	6,257,040.87	1.02%
9	富国中证 1000 指数增强 C	公募基金	5,922,269.17	0.96%
10	22 市北建投 PPN001	债券	5,643,156.76	0.92%

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	淄博生态产业新城投资发展集团有限公司	百瑞信托.淄博生态产业新城投资发展集团有限公司理财融资项目(百瑞富诚 906 号)	信托贷款	5.7880	345	正常
2	亳州文化旅游控股集团有限公司	亳州文化旅游控股集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.4000	76	正常
3	中信建投证券股份有限公司	收益凭证.中信建投进取宝 483 期.中证 1000 指数.S2V353/JTB113	收益凭证	无固定收益率	279	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）
国信证券股份有限公司	133647.SZ	23 渝隆 04	794,832.86

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）
2023年7月5日	80

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	10257000000893895

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。