

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 16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	华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 16 号
理财产品代码	22121016
A 份额销售代码	22121016A
B 份额销售代码	22121016B
C 份额销售代码	22121016C
D 份额销售代码	22121016D
E 份额销售代码	22121016E
F 份额销售代码	22121016F
产品登记编码	Z7003922000107
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	124.28%
产品起始日期	2022-10-18
产品终止日期	2023-11-14

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	1.0115	332,838,717.00	1.0115	336,675,560.48	1.81%
2022-12-31	0.9935	332,838,717.00	0.9935	330,673,850.44	

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	1.0119	23,546,455.00	1.0119	23,827,498.90	1.85%
2022-12-31	0.9935	26,696,455.00	0.9935	26,522,814.50	

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	1.0111	11,106,325.00	1.0111	11,229,308.45	1.79%
2022-12-31	0.9933	11,106,325.00	0.9933	11,031,849.65	

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	1.0106	190,234,464.00	1.0106	192,254,585.75	1.76%
2022-12-31	0.9931	190,234,464.00	0.9931	188,920,505.38	

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	1.0113	900,000.00	1.0113	910,170.30	1.80%
2022-12-31	0.9934	900,000.00	0.9934	894,055.55	

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	1.0120	6,050,000.00	1.0120	6,122,492.44	1.84%
2022-12-31	0.9937	6,050,000.00	0.9937	6,011,868.14	

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	0.87%	0.91%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	62.41%
5	非标准化债权类资产	45.52%	36.67%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	53.61%	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	百瑞信托.珠江实业(百瑞恒益 1243 号)	非标准化债权类 资产	100,119,216.69	14.11%
2	粤财信托.南京江宁(大学)科教创新 园有限公司理财融资项目 1107 到期 (瑞兴 29)	非标准化债权类 资产	60,043,988.29	8.46%
3	百瑞信托.重庆仙桃数据谷.百瑞富强 936 号	非标准化债权类 资产	50,055,319.54	7.05%
4	粤财信托.南京江宁滨江物流有限公 司理财融资项目 1107 到期(瑞丰 35 号)	非标准化债权类 资产	50,036,681.34	7.05%
5	华恒 01 优	债券	17,334,314.50	2.44%
6	20 镇交 02	债券	15,048,138.46	2.12%
7	20 粤珠江 MTN003	债券	14,474,301.02	2.04%
8	21 金阳 02	债券	13,583,186.71	1.91%
9	22 河钢 K1	债券	12,448,186.98	1.75%
10	22 德达 01	债券	12,218,832.84	1.72%

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	广州珠江实业集团有限公司	百瑞信托.珠江实业(百瑞恒益1243号)	信托贷款	4.77	206	正常
2	南京江宁(大学)科教创新园有限公司	粤财信托.南京江宁(大学)科教创新园有限公司理财融资项目1107到期(瑞兴29)	信托贷款	4.29	221	正常
3	重庆仙桃数据谷投资管理有限公司	百瑞信托.重庆仙桃数据谷.百瑞富强936号	信托贷款	5.01	216	正常
4	南京江宁滨江物流有限公司	粤财信托.南京江宁滨江物流有限公司理财融资项目1107到期(瑞丰35号)	信托贷款	4.29	221	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）
招商证券股份有限公司	032380258.IB	23 常德城投 PPN004	242,962.96

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

本产品投资的资管计划底层资产为债券资产，将根据产品到期时间，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 20 远资 01（代码 175093.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 0.039%，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

无持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10250000003313129

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。