

华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财 产品 16 号

2023 年第 2 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 4 月 1 日至 2023 年 6 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精选封闭式理财产品 16 号
理财产品代码	22151016
A 份额销售代码	22151016A
B 份额销售代码	22151016B
D 份额销售代码	22151016D
E 份额销售代码	22151016E
产品登记编码	Z7003922000155
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	112.16%
产品起始日期	2023-02-02
产品终止日期	2024-03-05

注：由于子份额可能存在募集金额或存续金额为 0，导致无持有人的情形，本报告仅列示报告期末存续金额不为 0 的相关子份额信息。

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
2023-06-30	1.0195	660,001.00	1.0195	672,885.74	1.06%
2023-03-31	1.0088	660,001.00	1.0088	665,787.75	

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
2023-06-30	1.0193	4,922,173.00	1.0193	5,017,237.75	1.05%
2023-03-31	1.0087	4,922,173.00	1.0087	4,964,992.01	

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
2023-06-30	1.0189	11,581,254.00	1.0189	11,800,096.88	1.03%
2023-03-31	1.0085	11,581,254.00	1.0085	11,679,835.43	

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
2023-06-30	1.0187	40,821,052.00	1.0187	41,583,902.47	1.02%
2023-03-31	1.0084	40,821,052.00	1.0084	41,165,731.97	

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	4.94%	5.44%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	22.46%
4	债券	0.00%	72.10%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
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	95.06%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	14,881,605.15	22.46%
2	21 江门滨江 PPN001	债券	5,490,784.35	8.29%
3	22 周口城投 PPN001	债券	3,778,018.35	5.70%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	3,602,109.86	5.44%
5	20 仪征城发 PPN001	债券	2,222,120.50	3.35%
6	21 新昌投资 PPN001	债券	2,221,117.15	3.35%
7	18 咸宁城投 MTN002	债券	2,219,736.38	3.35%
8	20 鲁公 03	债券	2,216,302.22	3.35%
9	20 江门滨江 PPN001	债券	2,205,602.06	3.33%
10	20 溧开 04	债券	2,204,325.26	3.33%

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

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

截止本报告日，债券价格波动处于合理的市场波动区间。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益持仓。

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	10250000003326387

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。