

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 23 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	华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 23 号
理财产品代码	22721023
产品登记编码	Z7003922A000011
产品募集方式	私募
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	130.40%
产品起始日期	2022-09-20
产品终止日期	2023-09-06

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
2023-03-31	1.0066	80,000,000.00	1.0066	80,526,418.25	1.94%
2022-12-31	0.9874	80,000,000.00	0.9874	78,989,153.81	

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	1.56%	1.75%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.13%
4	债券	0.00%	87.74%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	8.02%
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	1.30%	2.37%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	97.14%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,837,782.18	1.75%
2	民生优 1	权益类投资	1,792,593.89	1.71%
3	19 农业银行永续债 01	权益类投资	1,173,926.84	1.12%
4	华夏上证 50ETF 联接 C	公募基金	1,046,538.68	1.00%
5	19 广发银行永续债	权益类投资	931,739.27	0.89%
6	22 中海企业 MTN004	债券	929,172.42	0.88%
7	20 财达 C1	债券	916,391.42	0.87%
8	19 首旅 MTN002B	债券	916,186.52	0.87%
9	22 国海 02	债券	813,577.28	0.77%
10	20 潍坊 02	债券	753,020.03	0.72%

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
-	-	-	-	-	-	-

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

本产品为封闭式理财产品，在本报告期内未开放，产品持有 180 万元以上的现金等高流动性资产，能够应对一定的临时赎回，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。根据公司内部理财风险资产分类的认定，持仓中 PR 龙债 02（代码 166599.SH）的资产风险认定从正常类划分为关注类，该券在产品持仓中占比不高于 0.09%，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

本产品持有 8%左右的权益类资产，主要为优先股和永续债，以及少量的权益类公募基金，存在一定的市场风险，估值净价可能随市场波动。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000889153

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。