

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 3 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	华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 3 号
理财产品代码	22121003
A 份额销售代码	22121003A
B 份额销售代码	22121003B
C 份额销售代码	22121003C
D 份额销售代码	22121003D
E 份额销售代码	22121003E
F 份额销售代码	22121003F
S 份额销售代码	22121003S
Z 份额销售代码	22121003Z
产品登记编码	Z7003922000059
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	122.39%
产品起始日期	2022-07-01
产品终止日期	2023-08-01

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	1.0412	221,838,618.00	1.0412	230,984,414.70	1.46%
2023-03-31	1.0262	221,838,618.00	1.0262	227,660,226.79	

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	1.0412	256,711,954.00	1.0412	267,295,482.59	1.46%
2023-03-31	1.0262	256,711,954.00	1.0262	263,448,727.66	

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
2023-06-30	1.0397	154,868,801.00	1.0397	161,012,604.97	1.42%
2023-03-31	1.0251	154,868,801.00	1.0251	158,754,758.46	

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	1.0386	455,569,376.00	1.0386	473,170,220.56	1.40%
2023-03-31	1.0243	455,569,376.00	1.0243	466,651,362.99	

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	1.0415	362,896,086.00	1.0415	377,970,345.58	1.46%
2023-03-31	1.0265	362,896,086.00	1.0265	372,502,967.21	

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
2023-06-30	1.0407	444,368.00	1.0407	462,457.63	1.44%
2023-03-31	1.0259	444,368.00	1.0259	455,858.90	

S 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	1.0412	169,604,924.00	1.0412	176,597,269.03	1.46%
2023-03-31	1.0262	169,604,924.00	1.0262	174,055,787.98	

Z 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	1.0412	140,194,251.00	1.0412	145,974,074.57	1.46%
2023-03-31	1.0262	140,194,251.00	1.0262	143,873,304.05	

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	0.20%	0.34%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.44%
4	债券	0.00%	65.57%
5	非标准化债权类资产	41.10%	33.66%
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	58.70%	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	青岛军民融合发展集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类 资产	303,194,260.85	13.51%
2	河南东龙控股集团有限公司 2022 年 度第三期债权融资计划	非标准化债权类 资产	201,738,696.66	8.99%
3	粤财信托.江苏润城城市投资控股集 团有限责任公司(瑞丰 40)731 到期	非标准化债权类 资产	130,166,761.20	5.80%
4	厦门信托.盐城市交通投资建设控股 集团有限责任公司理财融资项目 731 到期	非标准化债权类 资产	70,089,794.49	3.12%
5	渤海信托.长沙雨花经开开发建设有 限公司理财融资项目(2022 金雀 105 号)	非标准化债权类 资产	50,065,175.33	2.23%
6	19 民生银行二级 01	债券	38,157,621.13	1.70%
7	20 民生银行二级	债券	33,747,961.93	1.50%
8	22 建租 01	债券	20,879,387.08	0.93%
9	20 饶城投绿债	债券	19,427,402.63	0.87%
10	22 文汇优	债券	19,408,687.17	0.86%

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	青岛军民融合发展集团有限公司	青岛军民融合发展集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.0000	14	正常
2	河南东龙控股集团有限公司	河南东龙控股集团有限公司 2022 年度第三期债权融资计划	债权融资计划	5.0000	28	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)731 到期	信托贷款	4.9100	31	正常
4	盐城市交通投资建设控股集团有限公司	厦门信托.盐城市交通投资建设控股集团有限公司理财融资项目 731 到期	信托贷款	4.9100	31	正常
5	长沙雨花经开开发建设有限公司	渤海信托.长沙雨花经开开发建设有限公司理财融资项目 (2022 金雀 105 号)	信托贷款	5.1000	28	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	251403.SH	23 铜建 06	7,065,305.60

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类及非标类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前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

本产品持仓债券未出现信用违约等信用风险事件,2023年2季度债券收益率整体以下行为主,全年来看资本利得收益贡献明显,整体波动率在合理区间范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

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	10257000000889834

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。