

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 10 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 10 号
理财产品代码	22121010
A 份额销售代码	22121010A
C 份额销售代码	22121010C
D 份额销售代码	22121010D
E 份额销售代码	22121010E
G 份额销售代码	22121010G
V 份额销售代码	22121010V
产品登记编码	Z7003922000066
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	126.69%
产品起始日期	2022-09-23
产品终止日期	2023-09-26

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	1.0305	2,830,681,641.00	1.0305	2,917,094,205.90	1.47%
2023-03-31	1.0156	2,830,681,641.00	1.0156	2,874,897,932.81	

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	1.0293	143,582,333.00	1.0293	147,795,274.40	1.43%
2023-03-31	1.0148	143,582,333.00	1.0148	145,711,863.68	

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	1.0286	263,794,655.00	1.0286	271,326,623.99	1.41%
2023-03-31	1.0143	263,794,655.00	1.0143	267,568,531.48	

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	1.0305	1,304,201,662.00	1.0305	1,344,014,567.02	1.47%
2023-03-31	1.0156	1,304,201,662.00	1.0156	1,324,573,163.53	

G 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	1.0297	3,000,000.00	1.0297	3,089,209.38	1.44%
2023-03-31	1.0151	3,000,000.00	1.0151	3,045,282.41	

V 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	1.0293	350,000,000.00	1.0293	360,269,575.40	1.43%
2023-03-31	1.0148	350,000,000.00	1.0148	355,190,999.37	

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	0.21%	0.96%
2	同业存单	0.00%	0.97%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.23%
4	债券	0.00%	69.70%
5	非标准化债权类资产	33.39%	26.39%
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%	1.76%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	66.40%	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	厦门信托.诸暨交通单一信托	非标准化债权类 资产	500,603,003.99	7.83%
2	百瑞信托.重庆市南部新城产业投资集团有限公司理财融资项目(百瑞富诚 931 号)	非标准化债权类 资产	494,644,767.10	7.74%
3	百瑞信托.成都空港兴城投资发展有限公司理财融资项目(百瑞富诚 806 号)	非标准化债权类 资产	390,531,889.55	6.11%
4	中铁信托.北塘湾(天津)科技发展有限公司理财融资项目(泉熙 22166 期)	非标准化债权类 资产	200,293,903.81	3.13%
5	渤海信托.2022 金雀 97 号(济南章丘控股集团有限公司融资项目)	非标准化债权类 资产	100,129,707.07	1.57%
6	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	61,281,292.98	0.96%
7	21 青岛银行二级	债券	48,468,395.55	0.76%
8	20 民生银行二级	债券	47,020,699.80	0.74%
9	22 国海 02	债券	37,349,972.23	0.58%
10	易方达恒久 1 年定期债券 A	公募基金	36,262,851.95	0.57%

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	诸暨市交通基础设施建设有限公司	厦门信托.诸暨交通单一信托	信托贷款	5.1600	87	正常
2	重庆市南部新城产业投资集团有限公司	百瑞信托.重庆市南部新城产业投资集团有限公司理财融资项目(百瑞富诚 931 号)	信托贷款	5.0156	87	正常
3	成都空港产业兴城投资发展有限公司	百瑞信托.成都空港兴城投资发展有限公司理财融资项目(百瑞富诚 806 号)	信托贷款	5.2075	87	正常
4	北塘湾(天津)科技发展有限公司	中铁信托.北塘湾(天津)科技发展有限公司理财融资项目(泉熙 22166 期)	信托贷款	6.0800	84	正常
5	济南章丘控股集团有限公司	渤海信托.2022 金雀 97 号(济南章丘控股集团有限公司融资项目)	信托贷款	5.4879	87	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	2,885,051.84

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）
中诚信托有 限责任公司	ZC19KY OTC	中诚信托汇鑫 11 号 集合资金信托计划	买入	30,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC1A2W OTC	中诚信托汇鑫 14 号 集合资金信托计划	买入	4,000,000.00

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	10250000003308164

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。