

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 10 号

2023 年半年度报告

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 1 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	3.53%
2022-12-31	0.9954	2,831,031,641.00	0.9954	2,818,043,209.40	

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	3.45%
2022-12-31	0.9950	143,582,333.00	0.9950	142,865,455.19	

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	3.41%
2022-12-31	0.9947	263,794,655.00	0.9947	262,406,394.61	

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	3.53%
2022-12-31	0.9954	1,304,201,662.00	0.9954	1,298,218,142.12	

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	3.48%
2022-12-31	0.9951	3,000,000.00	0.9951	2,985,426.37	

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	3.45%
2022-12-31	0.9950	350,000,000.00	0.9950	348,252,520.15	

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）
中国建设银行股份有限公司	112305034.IB	23 建设银行 CD034	17,033.21
中国建设银行股份有限公司	112305035.IB	23 建设银行 CD035	17,033.18

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）
英大基金管理有限公司	ydhywj01 OTC	英大基金-华英稳健 1号集合资产管理计 划	买入	10,000,000.00
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,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。

第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品存在投资运作过程中存在违反相关法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。