

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 6 号

2022 年第 4 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：2022 年 10 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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 6 号
理财产品代码	22121006
A 份额销售代码	22121006A
B 份额销售代码	22121006B
C 份额销售代码	22121006C
D 份额销售代码	22121006D
J 份额销售代码	22121006J
产品登记编码	Z7003922000064
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	126.32%
产品起始日期	2022-08-10
产品终止日期	2023-09-05

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
2022-12-31	1.0001	165,908,912.00	1.0001	165,924,447.49	-0.42%
2022-09-30	1.0043	165,908,912.00	1.0043	166,618,736.01	

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
2022-12-31	1.0001	227,267,333.00	1.0001	227,288,614.10	-0.42%
2022-09-30	1.0043	227,267,333.00	1.0043	228,239,672.66	

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
2022-12-31	0.9997	86,636,882.00	0.9997	86,611,055.36	-0.44%
2022-09-30	1.0041	86,636,882.00	1.0041	86,995,393.54	

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
2022-12-31	0.9993	365,055,225.00	0.9993	364,803,449.78	-0.47%
2022-09-30	1.0040	365,055,225.00	1.0040	366,514,646.77	

J 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
2022-12-31	1.0001	478,882,981.00	1.0001	478,927,822.82	-0.42%
2022-09-30	1.0043	478,882,981.00	1.0043	480,931,832.08	

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	0.17%	0.35%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.02%
4	债券	0.00%	63.28%
5	非标准化债权类资产	44.67%	35.40%
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%	0.95%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	55.16%	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。

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	北京市通州区国有资本运营有限公司 2022 年度第二期债权融资计划	非标准化债权类 资产	341,530,562.93	20.43%
2	渤海信托.淮北建投商贸理财融资项目(2022 金雀 108 号)	非标准化债权类 资产	150,154,812.86	8.98%
3	山东信托.洛阳国晟投资控股集团有限公司理财融资项目 22 年 8 月份(融华 1 号)	非标准化债权类 资产	100,136,120.07	5.99%
4	20 民生银行二级	债券	20,671,498.17	1.24%
5	22 国海 02	债券	8,769,538.03	0.52%
6	20 泰州城投 PPN001	债券	7,984,126.27	0.48%
7	22 威海 03	债券	7,718,367.02	0.46%
8	22 海恒 K2	债券	7,291,379.51	0.44%
9	22 中海企业 MTN004	债券	7,231,036.98	0.43%
10	20 财达 C1	债券	7,110,591.00	0.43%

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	北京市通州区国有资本运营有限公司	北京市通州区国有资本运营有限公司 2022 年度第二期债权融资计划	债权融资计划	5.20	238	正常
2	淮北市建投商贸有限公司	渤海信托.淮北建投商贸理财融资项目(2022 金雀 108 号)	信托贷款	5.20	212	正常
3	洛阳国晟投资控股集团有限公司	山东信托.洛阳国晟投资控股集团有限公司理财融资项目 22 年 8 月份(融华 1 号)	信托贷款	5.00	216	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	买入规模（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	买入规模（元）
华夏银行股份有限公司	102282373.IB	22 鹤壁投资 MTN003	71,488.11
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	633,718.30

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	交易金额（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

本产品以债券等固收类资产为主要投资标的，追求稳健回报，同时精选权益基金，为组合谋求超额收益。本产品固收部分主要投向资管计划以及债券，同时根据市场行情变化，动态调整相关资产的比例，平衡产品投资收益以及流动性。穿透资管计划，本产品投资的资管计划底层债券资产以 AA 以上评级债券为主，品种上以城投债以及国有企业债券为主。本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，做好流动性管理。

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，产品投资的债券资产信用展望稳定，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

截至本报告日，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	10257000000892564

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。