

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 6 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	121.53%
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
2023-03-31	1.0187	165,807,912.00	1.0187	168,914,436.86	1.86%
2022-12-31	1.0001	165,908,912.00	1.0001	165,924,447.49	

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
2023-03-31	1.0187	227,267,333.00	1.0187	231,523,864.20	1.86%
2022-12-31	1.0001	227,267,333.00	1.0001	227,288,614.10	

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
2023-03-31	1.0181	86,636,882.00	1.0181	88,203,201.31	1.84%
2022-12-31	0.9997	86,636,882.00	0.9997	86,611,055.36	

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
2023-03-31	1.0174	365,055,225.00	1.0174	371,417,950.38	1.81%
2022-12-31	0.9993	365,055,225.00	0.9993	364,803,449.78	

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
2023-03-31	1.0187	478,882,981.00	1.0187	487,852,067.16	1.86%
2022-12-31	1.0001	478,882,981.00	1.0001	478,927,822.82	

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	0.62%	0.88%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.28%
4	债券	0.00%	61.74%
5	非标准化债权类资产	43.84%	36.13%
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%	0.97%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	55.54%	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	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	341,515,028.41	20.85%
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	150,190,407.30	9.17%
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	100,148,937.17	6.11%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	14,368,674.41	0.88%
5	20 民生银行二级	债券	11,354,503.66	0.69%
6	22 中海企业 MTN004	债券	9,468,094.82	0.58%
7	21 青岛银行二级	债券	9,287,568.89	0.57%
8	22 国海 02	债券	9,171,176.66	0.56%
9	20 财达 C1	债券	8,865,690.61	0.54%
10	21 安紫 01	债券	8,262,934.20	0.50%

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	148	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	122	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	126	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	032380258.IB	23 常德城投 PPN004	636,812.41

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

本产品投资的资管计划底层资产为债券资产，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

截至本报告日，产品投资的债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无持仓。

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。