

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 4 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 4 号
理财产品代码	22121004
A 份额销售代码	22121004A
C 份额销售代码	22121004C
D 份额销售代码	22121004D
产品登记编码	Z7003922000063
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	111.39%
产品起始日期	2022-07-14
产品终止日期	2023-08-08

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	1.0380	1,365,780,907.00	1.0380	1,417,674,222.36	1.33%
2023-03-31	1.0244	1,365,780,907.00	1.0244	1,399,109,143.30	

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	1.0365	69,639,645.00	1.0365	72,181,480.96	1.29%
2023-03-31	1.0233	69,639,645.00	1.0233	71,262,873.71	

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	1.0355	154,874,292.00	1.0355	160,372,899.24	1.26%
2023-03-31	1.0226	154,874,292.00	1.0226	158,371,410.48	

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	0.06%	0.25%
2	同业存单	0.00%	0.07%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	60.57%
5	非标准化债权类资产	43.16%	38.84%
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%	0.27%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	56.78%	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	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	252,173,370.82	13.72%
2	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	200,260,701.31	10.89%
3	乐山国有资产投资运营(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	100,804,695.51	5.48%
4	平顶山发展投资控股集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类 资产	80,553,023.31	4.38%
5	渤海信托.河北顺德投资集团有限公 司理财融资项目	非标准化债权类 资产	80,104,043.20	4.36%
6	19 铜梁 01	债券	13,492,974.26	0.73%
7	19 信投 03	债券	12,024,003.80	0.65%
8	21 金阳 02	债券	10,948,096.78	0.60%
9	22 周投 01	债券	10,310,992.32	0.56%
10	22 河钢集 MTN001	债券	9,891,830.99	0.54%

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	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
2	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	乐山国有资产投资运营(集团)有限公司	乐山国有资产投资运营(集团)有限公司 2022 年度第三期债权融资计划	债权融资计划	5.7000	28	正常
4	平顶山发展投资控股集团有限公司	平顶山发展投资控股集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.0000	28	正常
5	河北顺德投资集团有限公司	渤海信托.河北顺德投资集团有限公司理财融资项目	信托贷款	5.0100	35	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	2,117,962.70

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

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

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。

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	10257000000891593

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。