

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 5 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 5 号 |
| 理财产品代码   | 22121005               |
| A 份额销售代码 | 22121005A              |
| B 份额销售代码 | 22121005B              |
| C 份额销售代码 | 22121005C              |
| D 份额销售代码 | 22121005D              |
| 产品登记编码   | Z7003922000060         |
| 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     | 121.73%                |
| 产品起始日期   | 2022-07-07             |
| 产品终止日期   | 2023-08-01             |

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<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0363      | 250,705,495.00 | 1.0363      | 259,800,409.40 | 1.44%         |
| 2023-03-31 | 1.0216      | 250,705,495.00 | 1.0216      | 256,110,025.52 |               |

### B 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0363      | 279,639,342.00 | 1.0363      | 289,783,897.87 | 1.44%         |
| 2023-03-31 | 1.0216      | 279,639,342.00 | 1.0216      | 285,667,607.76 |               |

### C 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0348      | 181,198,435.00 | 1.0348      | 187,495,796.27 | 1.41%         |
| 2023-03-31 | 1.0204      | 181,198,435.00 | 1.0204      | 184,901,601.26 |               |

### D 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0337      | 381,459,302.00 | 1.0337      | 394,329,598.27 | 1.37%         |
| 2023-03-31 | 1.0197      | 381,459,302.00 | 1.0197      | 388,970,596.84 |               |

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       | 0.46%     | 0.53%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.24%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 79.52%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 23.08%    | 19.01%    |
| 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%     | 0.70%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 76.46%    | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|-------------------------------------|---------------|----------------|-------------|
| 1  | 平顶山发展投资控股集团有限公司<br>2022 年度第一期债权融资计划 | 非标准化债权类<br>资产 | 261,797,325.76 | 19.01%      |
| 2  | 22 河钢集 MTN001                       | 债券            | 22,708,551.02  | 1.65%       |
| 3  | 22 宁波银行二级资本债 01                     | 债券            | 15,421,496.05  | 1.12%       |
| 4  | 21 国保 03                            | 债券            | 14,789,480.56  | 1.07%       |
| 5  | 22 衡阳 03                            | 债券            | 14,108,185.66  | 1.02%       |
| 6  | 19 民生银行二级 01                        | 债券            | 13,694,844.57  | 0.99%       |
| 7  | 22 周投 01                            | 债券            | 13,479,427.42  | 0.98%       |
| 8  | 22 宿州城投 PPN004                      | 债券            | 12,397,839.37  | 0.90%       |
| 9  | 22 义乌商品 MTN001                      | 债券            | 12,209,067.05  | 0.89%       |
| 10 | 20 民生银行二级                           | 债券            | 12,045,411.26  | 0.87%       |

### 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  | 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   |

### 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 | 2,533,343.07 |

#### 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

本产品在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 | 10257000000890215 |

## 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。