

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 8 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 8 号
理财产品代码	22121008
A 份额销售代码	22121008A
C 份额销售代码	22121008C
D 份额销售代码	22121008D
E 份额销售代码	22121008E
F 份额销售代码	22121008F
V 份额销售代码	22121008V
产品登记编码	Z7003922000078
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	126.73%
产品起始日期	2022-09-29
产品终止日期	2023-10-24

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	1.0280	24,740,000.00	1.0280	25,432,934.61	1.51%
2023-03-31	1.0127	24,740,000.00	1.0127	25,053,943.98	

### 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	1.0265	78,465,403.00	1.0265	80,542,112.68	1.46%
2023-03-31	1.0117	78,465,403.00	1.0117	79,381,474.53	

### 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	1.0257	157,129,499.00	1.0257	161,167,157.25	1.43%
2023-03-31	1.0112	157,129,499.00	1.0112	158,884,286.78	

### 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	1.0276	693,823,455.00	1.0276	712,988,893.91	1.50%
2023-03-31	1.0124	693,823,455.00	1.0124	702,451,786.07	

### F 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	1.0269	12,072,000.00	1.0269	12,396,155.73	1.48%
2023-03-31	1.0119	12,072,000.00	1.0119	12,216,000.43	

## 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	1.0265	220,000,000.00	1.0265	225,822,644.72	1.46%
2023-03-31	1.0117	220,000,000.00	1.0117	222,568,466.33	

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	0.35%	0.57%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.90%
4	债券	0.00%	70.25%
5	非标准化债权类资产	34.54%	27.28%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	65.12%	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	粤财信托.连云港市城建控股集团有限公司理财融资项目(瑞兴 28 号)	非标准化债权类 资产	150,155,671.07	9.73%
2	温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年第九期债权融资计划	非标准化债权类 资产	100,839,437.72	6.53%
3	百瑞信托.珠江实业(百瑞恒益 1243 号)	非标准化债权类 资产	100,110,337.24	6.48%
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	70,102,866.33	4.54%
5	华恒 01 优	债券	38,480,405.11	2.49%
6	20 粤珠江 MTN003	债券	31,984,465.97	2.07%
7	22 河钢 K1	债券	31,290,017.17	2.03%
8	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	29,357,216.98	1.90%
9	22 首股 02	债券	28,382,909.54	1.84%
10	21 威海城投 MTN001	债券	26,313,123.56	1.70%

### 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	连云港市城建控股集团有限公司	粤财信托.连云港市城建控股集团有限公司理财融资项目(瑞兴 28 号)	信托贷款	4.7238	105	正常
2	温州市鹿城区国有控股集团有限公司	温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年第九期债权融资计划	债权融资计划	4.9600	115	正常
3	广州珠江实业集团有限公司	百瑞信托.珠江实业(百瑞恒益 1243 号)	信托贷款	4.7724	115	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

### 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	1,751,926.17

#### 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

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。

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,但持仓过的部分资产主体信用评级和展望有所调整。其中,20远资01(175093.SH)发行人远洋资本有限公司2023年4月主体信用评级被中诚信国际信用评级有限责任公司由AA+调低至AA,评级展望调整为负面,后续已卖出,6月末已不再持有该债券。

#### 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	10257000000892950

## 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。