

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 64 号

2023 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：2023 年 10 月 1 日至 2023 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 64 号
理财产品代码	23121064
A 份额销售代码	23121064A
X 份额销售代码	23121064X
产品登记编码	Z7003923000019
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	114.71%
产品起始日期	2023-03-09
产品终止日期	2024-04-24

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
2023-12-31	1.0299	118,919,281.00	1.0299	122,475,415.13	0.93%
2023-09-30	1.0204	118,919,281.00	1.0204	121,339,817.01	

X 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
2023-12-31	1.0308	52,583,218.00	1.0308	54,200,180.41	0.97%
2023-09-30	1.0209	52,583,218.00	1.0209	53,682,724.51	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值*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	0.03%	1.72%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	60.74%
5	非标准化债权类资产	42.95%	37.55%
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	57.02%	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	中诚信托.重庆市涪陵实业发展集团有限公司信托贷款 0422 到期(2022 君诚 21 号)	非标准化债权类 资产	75,092,411.20	37.05%
2	21 青控 02	债券	16,493,653.94	8.14%
3	21 桂交 01	债券	15,588,194.51	7.69%
4	21 淮安交通 MTN001	债券	15,539,732.38	7.67%
5	21 三峡投资 PPN001	债券	15,492,746.85	7.64%
6	21 临空港投 PPN003	债券	15,481,804.38	7.64%
7	23 胶州湾 PPN001A	债券	15,391,166.02	7.59%
8	21 衡阳城投 PPN002	债券	13,713,761.33	6.77%
9	23 兴化城投 SCP002	债券	10,117,152.93	4.99%
10	21 万州经开 PPN001	债券	5,277,487.61	2.60%

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	重庆市涪陵实业发展集团有限公司	中诚信托.重庆市涪陵实业发展集团有限公司信托贷款0422 到期(2022 君诚 21 号)	信托贷款	4.8500	113	正常
2	四川省旅游投资集团有限责任公司	粤财信托.四川省旅游投资集团有限责任公司.第一期	信托贷款	4.8218	106	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）
-	-	-	-

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）
英大保险资产管理有限 公司	YD-HLYJ OTC	英大资产-活利壹玖 资产管理产品	买入	1,200,000.00

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份理财份额分红数（元）
-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品为摊余成本法计价的封闭式理财产品，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，并根据产品的期限，合理安排各类资产久期，预防流动性风险。

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，产品持仓债券整体波动率表现符合摊余成本法资产计价特征。

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	10250000003350354

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。