

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 137 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 137 号
理财产品代码	23121137
A 份额销售代码	23121137A
B 份额销售代码	23121137B
X 份额销售代码	23121137X
产品登记编码	Z7003923000191
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	120.85%
产品起始日期	2023-07-12
产品终止日期	2024-08-13

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	1.0211	500,046,277.00	1.0211	510,601,062.21	1.15%
2023-09-30	1.0095	500,046,277.00	1.0095	504,778,892.13	

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
2023-12-31	1.0204	44,193,844.00	1.0204	45,096,697.15	1.12%
2023-09-30	1.0091	44,193,844.00	1.0091	44,596,712.70	

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	1.0216	551,513,426.00	1.0216	563,440,855.11	1.18%
2023-09-30	1.0097	551,513,426.00	1.0097	556,861,248.40	

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	0.25%	0.35%
2	同业存单	0.00%	1.08%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.32%
4	债券	0.00%	61.83%
5	非标准化债权类资产	43.83%	36.42%
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	55.92%	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	华鑫信托.义乌市建设投资集团有限公司.建业 95 号.债权封闭 137 号	非标准化债权类资产	235,133,792.08	17.38%
2	中信信托.泰州医药城控股集团.华信 10.债权封闭 137 号 0717	非标准化债权类资产	100,125,799.97	7.40%
3	中信信托.青岛城投城金控股集团.华信 17.债权封闭 137 号	非标准化债权类资产	100,111,642.24	7.40%
4	中信信托.泰州医药城控股集团.华信 10.债权封闭 137 号 0728	非标准化债权类资产	57,272,072.15	4.23%
5	20 株国 06	债券	30,497,579.84	2.25%
6	23 青租 03	债券	19,439,333.81	1.44%
7	21 长城人寿 01	债券	15,941,842.89	1.18%
8	23 安租 Y4	债券	14,988,106.16	1.11%
9	23 中国银行 CD032	同业存单	14,620,500.36	1.08%
10	21 滨湖 01	债券	13,581,423.05	1.00%

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	义乌市建设投资集团有限公司	华鑫信托.义乌市建设投资集团有限公司.建业 95 号.债权封闭 137 号	信托贷款	4.3434	225	正常
2	泰州医药城控股集团有限公司	中信信托.泰州医药城控股集团有限公司.华信 10.债权封闭 137 号 0717	信托贷款	5.1139	226	正常
3	青岛城投城金控股集团有限公司	中信信托.青岛城投城金控股集团有限公司.华信 17.债权封闭 137 号	信托贷款	4.6830	225	正常
4	泰州医药城控股集团有限公司	中信信托.泰州医药城控股集团有限公司.华信 10.债权封闭 137 号 0728	信托贷款	5.1139	225	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）
-	-	-	-	-

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

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	10250000003375709

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。