

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 147 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 147 号
理财产品代码	23121147
A 份额销售代码	23121147A
B 份额销售代码	23121147B
X 份额销售代码	23121147X
产品登记编码	Z7003923000256
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	118.63%
产品起始日期	2023-08-09
产品终止日期	2024-09-10

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	1.0171	425,494,820.00	1.0171	432,753,313.36	1.21%
2023-09-30	1.0049	425,494,820.00	1.0049	427,561,960.06	

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	1.0165	40,187,393.00	1.0165	40,848,819.91	1.18%
2023-09-30	1.0046	40,187,393.00	1.0046	40,374,008.18	

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	1.0175	354,363,795.00	1.0175	360,550,759.30	1.24%
2023-09-30	1.0050	354,363,795.00	1.0050	356,136,066.20	

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	0.56%	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%	0.26%
4	债券	0.00%	60.39%
5	非标准化债权类资产	44.13%	37.31%
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%	1.47%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	55.32%	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	中信信托.知识城(广州)投资集团. 华信 30 号.债权封闭 147 号	非标准化债权类 资产	200,190,745.80	20.23%
2	渤海信托.长沙雨花经开开发建设有 限公司.债权封闭 147 号.臻享私募 35 号	非标准化债权类 资产	110,009,047.10	11.12%
3	中信信托.清远市德晟投资集团.华信 20 号.债权封闭 147 号.148 号	非标准化债权类 资产	58,998,678.20	5.96%
4	20 济宁城投永续期债	债券	20,758,903.97	2.10%
5	湘江 22Y	债券	14,732,364.98	1.49%
6	23 青租 03	债券	14,655,650.27	1.48%
7	景顺长城中短债债券 A	公募基金	14,528,461.82	1.47%
8	23 科城 Y2	债券	13,298,566.39	1.34%
9	23 华侨城 MTN003A	债券	13,272,749.18	1.34%
10	20 滁州同创债	债券	12,467,369.84	1.26%

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	知识城(广州)投资集团有限公司	中信信托.知识城(广州)投资集团.华信 30 号.债权封闭 147 号	信托贷款	4.3600	253	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.债权封闭 147 号.臻享私募 35 号	信托贷款	5.0173	252	正常
3	清远市德晟投资集团有限公司	中信信托.清远市德晟投资集团.华信 20 号.债权封闭 147 号.148 号	信托贷款	4.3000	253	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	10257000000942119

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。