

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 17 号

2023 年第 3 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 7 月 1 日至 2023 年 9 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 17 号
理财产品代码	22121017
A 份额销售代码	22121017A
B 份额销售代码	22121017B
C 份额销售代码	22121017C
D 份额销售代码	22121017D
E 份额销售代码	22121017E
F 份额销售代码	22121017F
J 份额销售代码	22121017J
Z 份额销售代码	22121017Z
产品登记编码	Z7003922000108
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	117.23%
产品起始日期	2022-11-02
产品终止日期	2023-12-05

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
2023-09-30	1.0308	121,391,593.00	1.0308	125,128,594.96	1.30%
2023-06-30	1.0176	121,391,593.00	1.0176	123,522,584.29	

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
2023-09-30	1.0308	224,787,151.00	1.0308	231,707,152.72	1.30%
2023-06-30	1.0176	224,787,151.00	1.0176	228,733,219.04	

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
2023-09-30	1.0298	418,771,986.00	1.0298	431,271,326.96	1.27%
2023-06-30	1.0169	418,771,986.00	1.0169	425,843,318.40	

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
2023-09-30	1.0289	569,851,988.00	1.0289	586,327,192.50	1.25%
2023-06-30	1.0162	569,851,988.00	1.0162	579,093,565.84	

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
2023-09-30	1.0303	1,430,000.00	1.0303	1,473,351.74	1.29%
2023-06-30	1.0172	1,430,000.00	1.0172	1,454,624.72	

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
2023-09-30	1.0317	5,470,000.00	1.0317	5,643,522.59	1.33%
2023-06-30	1.0182	5,470,000.00	1.0182	5,569,684.86	

J 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
2023-09-30	1.0313	409,235,866.00	1.0313	422,025,937.63	1.32%
2023-06-30	1.0179	409,235,866.00	1.0179	416,556,791.61	

Z 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
2023-09-30	1.0298	7,685,252.00	1.0298	7,914,638.44	1.27%
2023-06-30	1.0169	7,685,252.00	1.0169	7,815,024.38	

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	0.29%	0.74%
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%	73.29%
5	非标准化债权类资产	30.37%	25.97%
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	69.34%	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	华阳新材料科技集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	350,419,041.55	16.50%
2	江苏海晟控股集团有限公司 2022 年度第四期债权融资计划	非标准化债权类资产	201,102,606.08	9.47%
3	19 广基 01	债券	61,169,016.20	2.88%
4	19 环球 01	债券	60,626,888.02	2.85%
5	20 眉山发展 PPN001	债券	50,951,126.38	2.40%
6	19 伊川债	债券	44,028,580.14	2.07%
7	23 南新 02	债券	40,182,621.68	1.89%
8	19 昆交 05	债券	34,486,751.78	1.62%
9	21 安租 06	债券	30,620,576.45	1.44%
10	23 中原资产 MTN003	债券	30,234,418.92	1.42%

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	华阳新材料科技集团有限公司	华阳新材料科技集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	债权融资计划	4.7500	52	正常
2	江苏海晟控股集团有限公司	江苏海晟控股集团有限公司 2022 年度第四期债权融资计划	债权融资计划	4.3000	52	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）
首创证券股份有限公司	143356.SZ	23 新保 A1	1,773,205.46

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）
中诚信托有 限责任公司	ZC19KY OTC	中诚信托汇鑫 11 号 集合资金信托计划	买入	255,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC1A2W OTC	中诚信托汇鑫 14 号 集合资金信托计划	买入	15,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC1A34 OTC	中诚信托汇鑫 15 号 集合资金信托计划	买入	470,000,000.00

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3季度债券收益率小幅波动,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	10250000003313130

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。