

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 21 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 21 号
理财产品代码	22121021
A 份额销售代码	22121021A
B 份额销售代码	22121021B
D 份额销售代码	22121021D
K 份额销售代码	22121021K
X 份额销售代码	22121021X
产品登记编码	Z7003922000081
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	179.89%
产品起始日期	2023-01-05
产品终止日期	2024-02-20

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	1.0381	10,967,383.00	1.0381	11,385,168.59	0.83%
2023-06-30	1.0296	10,967,383.00	1.0296	11,291,707.99	

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	1.0381	25,819,000.00	1.0381	26,802,535.11	0.83%
2023-06-30	1.0296	25,819,000.00	1.0296	26,582,513.62	

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	1.0366	39,111,968.00	1.0366	40,542,815.57	0.78%
2023-06-30	1.0286	39,111,968.00	1.0286	40,230,227.43	

K 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	1.0377	61,500,749.00	1.0377	63,821,068.97	0.81%
2023-06-30	1.0294	61,500,749.00	1.0294	63,305,896.96	

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
2023-09-30	1.0381	18,387,323.00	1.0381	19,087,759.58	0.83%
2023-06-30	1.0296	18,387,323.00	1.0296	18,931,068.49	

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	0.01%	0.65%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.66%
4	债券	0.00%	98.69%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
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	99.99%	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	20 粤珠江 MTN003	债券	16,117,612.77	5.54%
2	华恒 01 优	债券	13,324,651.39	4.58%
3	22 建房 F1	债券	11,741,000.87	4.04%
4	21 华租 01	债券	10,559,319.02	3.63%
5	22 中交房产 MTN001	债券	10,530,282.42	3.62%
6	21 首创 C1	债券	9,286,469.12	3.19%
7	22 首股 02	债券	9,122,540.37	3.14%
8	21 海恒投资 MTN003	债券	7,999,635.87	2.75%
9	19 宁城 02	债券	7,998,976.72	2.75%
10	22 漳九 02	债券	7,995,914.14	2.75%

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
-	-	-	-	-	-	-

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

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	10250000003311337

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。