

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 80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 80 号
理财产品代码	23121080
M 份额销售代码	23121080M
N 份额销售代码	23121080N
产品登记编码	Z7003923000095
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	104.12%
产品起始日期	2023-05-25
产品终止日期	2025-06-10

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

M 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	1.0169	183,619,078.00	1.0169	186,713,835.29	1.36%
2023-06-30	1.0033	183,619,078.00	1.0033	184,232,133.46	

N 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	1.0172	79,264,000.00	1.0172	80,630,340.04	1.38%
2023-06-30	1.0034	79,264,000.00	1.0034	79,536,485.08	

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	0.67%	2.36%
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%	74.28%
5	非标准化债权类资产	24.24%	23.36%
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	75.09%	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	山东信托·岳阳市城市建设投资集团有限公司理财融资项目第四期(固收债权封闭 80 号)	非标准化债权类资产	40,018,302.64	14.38%
2	渤海信托·常德市城市发展集团有限公司理财融资项目第二期(固收债权封闭 80 号)	非标准化债权类资产	25,010,246.22	8.98%
3	22 文汇优	债券	19,760,759.58	7.10%
4	20 衡阳城投 PPN002	债券	19,624,252.74	7.05%
5	20 衡阳城投 PPN003	债券	19,611,249.23	7.05%
6	20 周口投资 MTN001	债券	19,551,352.40	7.02%
7	20 白沙 01	债券	19,424,501.52	6.98%
8	22 金阳集团债 02	债券	19,419,858.66	6.98%
9	22 南新 02	债券	19,231,984.95	6.91%
10	22 甘电投 MTN001	债券	19,180,798.89	6.89%

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	岳阳市城市建设投资集团有限公司	山东信托.岳阳市城市建设投资集团有限公司理财融资项目第四期（固收债权封闭 80 号）	信托贷款	4.6200	611	正常
2	常德市城市发展集团有限公司	渤海信托.常德市城市发展集团有限公司理财融资项目第二期（固收债权封闭 80 号）	信托贷款	4.9100	611	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

本产品在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、债券类及非标类资产,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,组合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	10250000003368066

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。