

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 21 号

## 2023 年第 2 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 4 月 1 日至 2023 年 6 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     | 142.92%                 |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0296      | 10,967,383.00 | 1.0296      | 11,291,707.99 | 1.37%         |
| 2023-03-31 | 1.0157      | 10,967,383.00 | 1.0157      | 11,139,789.05 |               |

### B 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0296      | 25,819,000.00 | 1.0296      | 26,582,513.62 | 1.37%         |
| 2023-03-31 | 1.0157      | 25,819,000.00 | 1.0157      | 26,224,871.85 |               |

### D 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0286      | 39,111,968.00 | 1.0286      | 40,230,227.43 | 1.31%         |
| 2023-03-31 | 1.0153      | 39,111,968.00 | 1.0153      | 39,708,806.64 |               |

### K 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0294      | 61,500,749.00 | 1.0294      | 63,305,896.96 | 1.36%         |
| 2023-03-31 | 1.0156      | 61,500,749.00 | 1.0156      | 62,459,692.36 |               |

### X 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0296      | 18,387,323.00 | 1.0296      | 18,931,068.49 | 1.37%         |
| 2023-03-31 | 1.0157      | 18,387,323.00 | 1.0157      | 18,676,369.42 |               |

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值\*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       | 1.70%     | 1.67%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 3.50%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 94.83%    |
| 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        | 98.30%    | 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”类别中包含永续债和优先股。

### 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------|-----------------|---------------|-------------|
| 1  | 华恒 01 优        | 债券              | 11,373,620.52 | 4.96%       |
| 2  | 20 粤珠江 MTN003  | 债券              | 9,500,427.25  | 4.15%       |
| 3  | 债券买入返售         | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 8,020,614.21  | 3.50%       |
| 4  | 22 河钢 K1       | 债券              | 7,903,943.11  | 3.45%       |
| 5  | 21 威海城投 MTN001 | 债券              | 7,815,854.00  | 3.41%       |
| 6  | 22 首股 02       | 债券              | 7,736,392.63  | 3.38%       |
| 7  | 22 建房 F1       | 债券              | 6,907,592.18  | 3.01%       |
| 8  | 21 华租 01       | 债券              | 6,224,686.27  | 2.72%       |
| 9  | 22 中交房产 MTN001 | 债券              | 6,205,825.55  | 2.71%       |
| 10 | 21 中航租赁 MTN001 | 债券              | 5,497,540.56  | 2.40%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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 | 每万份份额分红 | 每万份现金分红 |
|------|---------|---------|
| -    | -       | -       |

## 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

2023 年 2 季度债券收益率整体以下行为主,全年来看资本利得收益贡献明显,整体波动率在合理区间范围内。

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,但持仓过的部分资产主体信用评级和展望有所调整。其中,20 远资 01 (175093.SH) 发行人远洋资本有限公司 2023 年 6 月主体信用评级被中诚信国际信用评级有限责任公司 AA 调低至 A+, 评级展望维持负面,后续已卖出,6 月末已不再持有该债券。

#### 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。