

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 61 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 61 号
理财产品代码	23121061
A 份额销售代码	23121061A
B 份额销售代码	23121061B
C 份额销售代码	23121061C
E 份额销售代码	23121061E
产品登记编码	Z7003923000016
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	103.73%
产品起始日期	2023-03-02
产品终止日期	2024-04-01

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	1.0229	2,066,003,100.00	1.0229	2,113,364,885.29	1.03%
2023-06-30	1.0125	2,066,003,100.00	1.0125	2,091,880,737.60	

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	1.0226	3,950,000.00	1.0226	4,039,394.16	1.01%
2023-06-30	1.0124	3,950,000.00	1.0124	3,998,818.26	

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	1.0223	23,285,287.00	1.0223	23,805,447.13	1.00%
2023-06-30	1.0122	23,285,287.00	1.0122	23,569,196.60	

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	1.0218	110,710,000.00	1.0218	113,118,297.37	0.98%
2023-06-30	1.0119	110,710,000.00	1.0119	112,023,017.99	

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	0.17%	0.30%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.43%
4	债券	0.00%	56.90%
5	非标准化债权类资产	43.90%	42.37%
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	55.93%	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	粤财信托.吉安城投控股集团有限公司(瑞兴 32 号)	非标准化债权类 资产	405,378,105.54	17.34%
2	粤财信托.徐州经济技术开发区国有资产经营有限责任公司(瑞兴 37 号) 0401 到期	非标准化债权类 资产	265,226,274.95	11.34%
3	交银国信.常德市金禹水利投资有限公司(稳赢 674) 第三期	非标准化债权类 资产	250,228,630.71	10.70%
4	21 淮水 01	债券	165,132,891.31	7.06%
5	21 德财 01	债券	154,085,429.71	6.59%
6	23 上饶国资 PPN001A	债券	153,926,851.74	6.58%
7	21 咸官 02	债券	124,028,523.52	5.30%
8	19 皋投 01	债券	92,046,919.33	3.94%
9	21 淄博城资 PRN001	债券	82,370,843.25	3.52%
10	21 六新 01	债券	79,987,950.47	3.42%

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	吉安城投控股集团有限公司	粤财信托.吉安城投控股集团有限公司(瑞兴 32 号)	信托贷款	4.8205	153	正常
2	徐州经济技术开发区国有资产经营有限责任公司	粤财信托.徐州经济技术开发区国有资产经营有限责任公司(瑞兴 37 号) 0401 到期	信托贷款	4.8254	184	正常
3	常德市金禹水利投资有限公司	交银国信.常德市金禹水利投资有限公司(稳赢 674) 第三期	信托贷款	5.0150	181	正常
4	青岛胶州城市发展投资有限公司	中铁信托.青岛胶州城市发展投资有限公司(银杏 23010 期) 第二期 0329 到期	信托贷款	5.1059	181	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

本产品为摊余成本法计价的封闭式理财产品，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，并根据产品的期限，合理安排各类资产久期，预防流动性风险。

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，产品持仓债券整体波动率表现符合摊余成本法资产计价特征。

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	10250000003344272

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。