

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 71 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 71 号
理财产品代码	23121071
A 份额销售代码	23121071A
C 份额销售代码	23121071C
产品登记编码	Z7003923000071
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	103.06%
产品起始日期	2023-02-22
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	1.0267	3,359,361,613.00	1.0267	3,448,936,425.46	1.04%
2023-06-30	1.0161	3,359,361,613.00	1.0161	3,413,479,256.00	

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	1.0260	97,219,967.00	1.0260	99,751,853.15	1.01%
2023-06-30	1.0157	97,219,967.00	1.0157	98,748,888.53	

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	0.03%	0.20%
2	同业存单	0.00%	6.95%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	50.35%
5	非标准化债权类资产	43.73%	42.50%
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	56.25%	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.九江市国有投资控股集团 (慧融 26 号)	非标准化债权类 资产	399,447,880.94	10.92%
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)	非标准化债权类 资产	235,273,822.29	6.43%
3	中诚信托.南京江宁水务集团 (诚晟 25 号第十一号第 2 期)	非标准化债权类 资产	218,721,950.07	5.98%
4	中诚信托.盐城市城市资产投资集团 (诚晟 25 号第四号第 2 期)	非标准化债权类 资产	200,273,870.88	5.48%
5	中诚信托.长沙市芙蓉城市建设投资 集团 (诚晟 25 号第八号第 2 期)	非标准化债权类 资产	200,247,714.51	5.48%
6	湖州经开投资发展集团有限公司理 财融资项目 (第二期)	非标准化债权类 资产	200,227,976.88	5.47%
7	23 天津轨交 SCP001	债券	123,506,248.78	3.38%
8	连云港市城建控股集团有限公司理 财融资项目 0228A	非标准化债权类 资产	100,119,467.12	2.74%
9	19 赣振 02	债券	97,662,706.47	2.67%
10	22 万州经开 CP003(科创票据)	债券	88,303,421.10	2.41%

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	九江市国有投资控股集团有限公司	粤财信托.九江市国有投资控股集团有限公司(慧融 26 号)	信托贷款	4.5095	65	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)	信托贷款	4.8254	65	正常
3	南京江宁水务集团有限公司	中诚信托.南京江宁水务集团(诚晟 25 号第十一号第 2 期)	信托贷款	4.0532	55	正常
4	盐城市城市资产投资集团有限公司	中诚信托.盐城市城市资产投资集团(诚晟 25 号第四号第 2 期)	信托贷款	4.9075	65	正常
5	长沙市芙蓉城市建设投资集团有限公司	中诚信托.长沙市芙蓉城市建设投资集团(诚晟 25 号第八号第 2 期)	信托贷款	4.6269	65	正常
6	湖州经开投资发展集团有限公司	湖州经开投资发展集团有限公司理财融资项目(第二期)	债权融资计划	4.8000	65	正常
7	连云港市城建控股集团有限公司	连云港市城建控股集团有限公司理财融资项目 0228A	债权融资计划	5.0000	65	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）
兴业银行股份有限公司	112210298.IB	22 兴业银行 CD298	59,531,893.48
兴业银行股份有限公司	112310219.IB	23 兴业银行 CD219	67,887,624.25

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

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，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

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，产品投资的债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。

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	10250000003346086

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。