

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 104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 104 号
理财产品代码	23121104
A 份额销售代码	23121104A
B 份额销售代码	23121104B
C 份额销售代码	23121104C
产品登记编码	Z7003923000132
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	109.89%
产品起始日期	2023-05-17
产品终止日期	2024-06-18

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	1.0164	522,708,804.00	1.0164	531,258,616.14	1.20%
2023-06-30	1.0043	522,958,804.00	1.0043	525,211,592.02	

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	1.0160	56,239,231.00	1.0160	57,138,429.82	1.18%
2023-06-30	1.0042	56,239,231.00	1.0042	56,474,689.46	

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	1.0164	50,000,000.00	1.0164	50,817,766.87	1.20%
2023-06-30	1.0043	50,000,000.00	1.0043	50,215,388.64	

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	0.07%	0.20%
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%	60.30%
5	非标准化债权类资产	43.30%	39.51%
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	56.63%	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	中信信托·华夏五冶应收账款集合资 金信托计划·240513 到期	非标准化债权类 资产	147,411,296.15	20.98%
2	中信信托·青岛城市建设投资理财融 资项目·华信 11.0618 到期	非标准化债权类 资产	130,113,833.49	18.52%
3	23 海资 03	债券	14,190,616.12	2.02%
4	22 新海连 MTN002	债券	11,445,710.54	1.63%
5	20 金泰精诚 ABN001 优先	债券	11,324,257.68	1.61%
6	21 宜春 01	债券	10,786,760.60	1.54%
7	21 楚兴 ABN001 优先	债券	10,046,224.04	1.43%
8	23 领航 32	债券	9,763,392.44	1.39%
9	22GT2A2	债券	9,600,033.58	1.37%
10	22 绵阳交通 MTN001	债券	7,247,764.32	1.03%

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	中国五冶集团有限公司	中信信托.华夏五冶应收账款集合资金信托计划.240513到期	应收账款	5.0300	226	正常
2	青岛城市建设投资(集团)有限责任公司	中信信托.青岛城市建设投资理财融资项目.华信 11.0618到期	信托贷款	4.5400	262	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	2028042.IB	20 兴业银行永续债	4,483,971.44

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、债券类,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

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,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	10250000003367062

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。