

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 17 号

2023 年第 1 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 01 月 01 日至 2023 年 3 月 31 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 17 号
理财产品代码	22121017
A 份额销售代码	22121017A
B 份额销售代码	22121017B
C 份额销售代码	22121017C
D 份额销售代码	22121017D
E 份额销售代码	22121017E
F 份额销售代码	22121017F
J 份额销售代码	22121017J
Z 份额销售代码	22121017Z
产品登记编码	Z7003922000108
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	128.58%
产品起始日期	2022-11-02
产品终止日期	2023-12-05

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
2023-03-31	1.0039	121,391,593.00	1.0039	121,860,197.27	1.95%
2022-12-31	0.9847	121,391,593.00	0.9847	119,536,437.00	

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
2023-03-31	1.0039	224,787,151.00	1.0039	225,654,890.23	1.95%
2022-12-31	0.9847	224,787,151.00	0.9847	221,351,861.87	

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
2023-03-31	1.0035	418,771,986.00	1.0035	420,216,987.64	1.92%
2022-12-31	0.9846	418,771,986.00	0.9846	412,305,471.85	

D 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
2023-03-31	1.0030	569,851,988.00	1.0030	571,584,927.19	1.89%
2022-12-31	0.9844	569,851,988.00	0.9844	560,961,847.83	

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
2023-03-31	1.0037	1,430,000.00	1.0037	1,435,227.02	1.94%
2022-12-31	0.9846	1,430,000.00	0.9846	1,408,032.14	

F 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
2023-03-31	1.0043	5,470,000.00	1.0043	5,493,357.59	1.97%
2022-12-31	0.9849	5,470,000.00	0.9849	5,387,276.12	

J 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
2023-03-31	1.0041	409,235,866.00	1.0041	410,899,485.27	1.96%
2022-12-31	0.9848	409,235,866.00	0.9848	403,014,336.13	

Z 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
2023-03-31	1.0035	7,685,252.00	1.0035	7,711,770.55	1.92%
2022-12-31	0.9846	7,685,252.00	0.9846	7,566,579.41	

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	0.00%	0.28%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.24%
4	债券	0.00%	75.18%
5	非标准化债权类资产	31.21%	24.30%
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	68.79%	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 (元)	占总资产 的比例
1	华阳新材料科技集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	350,341,899.93	15.44%
2	江苏海晟控股集团有限公司 2022 年度第四期债权融资计划	非标准化债权类资产	200,960,571.23	8.86%
3	华恒 01 优	债券	45,743,252.77	2.02%
4	20 镇交 02	债券	39,561,810.26	1.74%
5	20 粤珠江 MTN003	债券	38,053,181.94	1.68%
6	22 河钢 K1	债券	36,926,245.75	1.63%
7	21 金阳 02	债券	35,710,427.36	1.57%
8	21 威海城投 MTN001	债券	31,342,936.11	1.38%
9	22 德达 01	债券	31,052,830.42	1.37%
10	21 华租 01	债券	25,916,795.96	1.14%

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	华阳新材料科技集团有限公司	华阳新材料科技集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	债权融资计划	4.75	235	正常
2	江苏海晟控股集团有限公司	江苏海晟控股集团有限公司 2022 年度第四期债权融资计划	债权融资计划	4.30	235	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）
招商证券股份有限公司	032380258.IB	23 常德城投 PPN004	2,759,804.31

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、债券及非标准化债权类资产,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

本产品持有债券未出现信用违约等信用风险事件,一季度债券收益率整体呈下行态势,有一定的资本利得收益,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	10250000003313130

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。