

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 19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 19 号 |
| 理财产品代码   | 22121019                |
| A 份额销售代码 | 22121019A               |
| B 份额销售代码 | 22121019B               |
| C 份额销售代码 | 22121019C               |
| D 份额销售代码 | 22121019D               |
| K 份额销售代码 | 22121019K               |
| X 份额销售代码 | 22121019X               |
| 产品登记编码   | Z7003922000126          |
| 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     | 109.01%                 |
| 产品起始日期   | 2022-12-15              |
| 产品终止日期   | 2024-01-16              |

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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0358      | 14,799,035.00 | 1.0358      | 15,328,343.97 | 0.89%         |
| 2023-06-30 | 1.0267      | 14,799,035.00 | 1.0267      | 15,193,810.75 |               |

### 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 |
|------------|-------------|--------------|-------------|--------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0358      | 2,500,000.00 | 1.0358      | 2,589,414.76 | 0.89%         |
| 2023-06-30 | 1.0267      | 2,500,000.00 | 1.0267      | 2,566,688.47 |               |

### C 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0350      | 10,060,542.00 | 1.0350      | 10,412,158.68 | 0.87%         |
| 2023-06-30 | 1.0261      | 10,060,542.00 | 1.0261      | 10,323,122.98 |               |

### 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 |
|------------|-------------|--------------|-------------|--------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0341      | 4,842,212.00 | 1.0341      | 5,007,496.76 | 0.83%         |
| 2023-06-30 | 1.0256      | 4,842,212.00 | 1.0256      | 4,966,049.19 |               |

### 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0354      | 17,019,308.00 | 1.0354      | 17,621,079.40 | 0.88%         |
| 2023-06-30 | 1.0264      | 17,019,308.00 | 1.0264      | 17,467,985.69 |               |

### 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 |
|------------|-------------|--------------|-------------|--------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0358      | 6,000,000.00 | 1.0358      | 6,214,598.47 | 0.89%         |
| 2023-06-30 | 1.0267      | 6,000,000.00 | 1.0267      | 6,160,054.72 |               |

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       | 0.29%     | 1.64%     |
| 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%     | 98.36%    |
| 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        | 99.71%    | 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<br>(元)  | 占总资产的<br>比例 |
|----|----------------|------|--------------|-------------|
| 1  | 22 周口城投 PPN001 | 债券   | 4,329,991.14 | 6.95%       |
| 2  | 21 华鑫置业 PPN001 | 债券   | 4,314,726.34 | 6.92%       |
| 3  | 21 江门滨江 PPN001 | 债券   | 3,761,950.33 | 6.04%       |
| 4  | 21 新昌投资 PPN001 | 债券   | 2,567,205.97 | 4.12%       |
| 5  | 20 鲁公 03       | 债券   | 2,542,272.78 | 4.08%       |
| 6  | 20 仪征城发 PPN001 | 债券   | 2,541,464.93 | 4.08%       |
| 7  | 18 咸宁城投 MTN002 | 债券   | 2,534,854.09 | 4.07%       |
| 8  | 20 溧开 04       | 债券   | 2,519,341.06 | 4.04%       |
| 9  | 20 江门滨江 PPN001 | 债券   | 2,517,986.45 | 4.04%       |
| 10 | 20 桐庐国运 PPN002 | 债券   | 2,515,977.41 | 4.04%       |

### 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 | 10250000003321797 |

## 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。