

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 64 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 64 号 |
| 理财产品代码   | 23121064                |
| A 份额销售代码 | 23121064A               |
| X 份额销售代码 | 23121064X               |
| 产品登记编码   | Z7003923000019          |
| 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     | 114.72%                 |
| 产品起始日期   | 2023-03-09              |
| 产品终止日期   | 2024-04-24              |

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 | 1.0204      | 118,919,281.00 | 1.0204      | 121,339,817.01 | 0.98%         |
| 2023-06-30 | 1.0105      | 118,919,281.00 | 1.0105      | 120,163,822.40 |               |

### 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 | 1.0209      | 52,583,218.00 | 1.0209      | 53,682,724.51 | 1.00%         |
| 2023-06-30 | 1.0108      | 52,583,218.00 | 1.0108      | 53,149,974.54 |               |

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       | 0.80%     | 1.42%     |
| 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%     | 60.69%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 43.39%    | 37.89%    |
| 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        | 55.81%    | 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<br>的比例 |
|----|------------------------------------------------|---------------|---------------|-------------|
| 1  | 中诚信托.重庆市涪陵实业发展集团有限公司信托贷款 0422 到期(2022 君诚 21 号) | 非标准化债权类<br>资产 | 75,070,596.72 | 37.39%      |
| 2  | 21 青控 02                                       | 债券            | 16,313,042.58 | 8.12%       |
| 3  | 21 桂交 01                                       | 债券            | 15,408,697.46 | 7.67%       |
| 4  | 21 淮安交通 MTN001                                 | 债券            | 15,402,730.42 | 7.67%       |
| 5  | 21 三峡投资 PPN001                                 | 债券            | 15,337,471.82 | 7.64%       |
| 6  | 21 临空港投 PPN003                                 | 债券            | 15,336,037.92 | 7.64%       |
| 7  | 23 胶州湾 PPN001A                                 | 债券            | 15,265,444.16 | 7.60%       |
| 8  | 21 衡阳城投 PPN002                                 | 债券            | 13,577,850.10 | 6.76%       |
| 9  | 23 兴化城投 SCP002                                 | 债券            | 10,024,445.22 | 4.99%       |
| 10 | 21 万州经开 PPN001                                 | 债券            | 5,193,158.89  | 2.59%       |

### 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  | 重庆市涪陵实业发展集团有限公司 | 中诚信托.重庆市涪陵实业发展集团有限公司信托贷款0422 到期(2022 君诚 21 号) | 信托贷款 | 4.8500 | 205     | 正常   |
| 2  | 四川省旅游投资集团有限责任公司 | 粤财信托.四川省旅游投资集团有限责任公司.第一期                      | 信托贷款 | 4.8218 | 198     | 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 | 10250000003350354 |

## **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。