

华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 35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	华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 35 号
理财产品代码	23111035
产品登记编码	Z7003923000045
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	100.46%
产品起始日期	2023-04-18
产品终止日期	2023-10-24

第二章 净值、存续规模及收益表现

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	1.0158	95,000,000.00	1.0158	96,496,968.90	0.82%
2023-06-30	1.0075	95,000,000.00	1.0075	95,708,127.60	

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	0.55%	0.82%
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%	99.08%
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%	0.09%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.45%	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	19 昆交 05	债券	7,572,533.86	7.81%
2	PR 筑城 02	债券	6,150,570.13	6.34%
3	23 豫航空港 PPN005	债券	5,781,979.71	5.96%
4	23 商丘发展 SCP003	债券	5,294,367.77	5.46%
5	23 商丘发展 CP002	债券	5,280,127.65	5.45%
6	23 益阳 01	债券	5,229,838.23	5.39%
7	19 永煤 MTN001	债券	5,107,025.66	5.27%
8	20 华融 F1	债券	4,763,149.58	4.91%
9	21 渝枢 02	债券	4,177,885.34	4.31%
10	20 郴投集团 MTN001	债券	4,077,513.56	4.21%

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
-	-	-	-	-	-	-

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）
中诚信托有 限责任公司	ZC19KY OTC	中诚信托汇鑫 11 号 集合资金信托计划	买入	95,000,000.00

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，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，提前储备流动性资金；二是根据当前市场收益率情况及对未来市场趋势的研判，合理制定组合加权久期，防范流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出、基金赎回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总体资质较优。价格波动在正常范围之内。

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	10250000003339931

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。