

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 18 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 18 号
理财产品代码	22121018
A 份额销售代码	22121018A
B 份额销售代码	22121018B
C 份额销售代码	22121018C
D 份额销售代码	22121018D
G 份额销售代码	22121018G
V 份额销售代码	22121018V
X 份额销售代码	22121018X
产品登记编码	Z7003922000109
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	147.75%
产品起始日期	2022-11-16
产品终止日期	2023-12-12

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	1.0128	12,720,709.00	1.0128	12,883,369.43	2.33%
2022-12-31	0.9897	12,720,709.00	0.9897	12,589,229.23	

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	1.0128	42,002,872.00	1.0128	42,539,964.23	2.33%
2022-12-31	0.9897	42,002,872.00	0.9897	41,568,734.87	

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	1.0124	48,252,394.00	1.0124	48,851,329.55	2.31%
2022-12-31	0.9895	48,252,394.00	0.9895	47,747,774.04	

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	1.0120	154,086,598.00	1.0120	155,941,524.36	2.28%
2022-12-31	0.9894	154,086,598.00	0.9894	152,456,370.41	

G 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	1.0126	374,700.00	1.0126	379,421.17	2.32%
2022-12-31	0.9896	374,700.00	0.9896	370,804.41	

V 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	1.0124	50,000,000.00	1.0124	50,620,627.79	2.31%
2022-12-31	0.9895	50,000,000.00	0.9895	49,477,103.80	

X 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	1.0132	1,500,000.00	1.0132	1,519,742.74	2.36%
2022-12-31	0.9898	1,500,000.00	0.9898	1,484,679.18	

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	0.24%	0.51%
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%	99.49%
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	99.76%	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	华恒 01 优	债券	22,767,509.62	4.93%
2	20 镇交 02	债券	19,784,716.90	4.28%
3	20 粤珠江 MTN003	债券	19,030,257.38	4.12%
4	21 金阳 02	债券	17,858,654.37	3.86%
5	22 河钢 K1	债券	15,802,067.45	3.42%
6	21 威海城投 MTN001	债券	15,674,487.94	3.39%
7	22 德达 01	债券	15,529,407.15	3.36%
8	21 华租 01	债券	12,960,895.06	2.80%
9	21 中航租赁 MTN001	债券	11,033,258.37	2.39%
10	21 山东国惠 MTN001	债券	11,025,375.48	2.39%

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）
招商证券股份有限公司	032380258.IB	23 常德城投 PPN004	34,426.76

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	10250000003313163

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。