

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 19 号

2023 年第 2 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 4 月 1 日至 2023 年 6 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	112.92%
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 (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
2023-06-30	1.0267	14,799,035.00	1.0267	15,193,810.75	1.09%
2023-03-31	1.0156	14,799,035.00	1.0156	15,029,656.83	

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
2023-06-30	1.0267	2,500,000.00	1.0267	2,566,688.47	1.09%
2023-03-31	1.0156	2,500,000.00	1.0156	2,538,958.44	

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
2023-06-30	1.0261	10,060,542.00	1.0261	10,323,122.98	1.06%
2023-03-31	1.0153	10,060,542.00	1.0153	10,214,384.23	

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
2023-06-30	1.0256	4,842,212.00	1.0256	4,966,049.19	1.04%
2023-03-31	1.0150	4,842,212.00	1.0150	4,914,843.84	

K 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
2023-06-30	1.0264	17,019,308.00	1.0264	17,467,985.69	1.07%
2023-03-31	1.0155	17,019,308.00	1.0155	17,282,470.62	

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
2023-06-30	1.0267	6,000,000.00	1.0267	6,160,054.72	1.09%
2023-03-31	1.0156	6,000,000.00	1.0156	6,093,501.28	

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	0.33%	1.35%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	23.43%
4	债券	0.00%	75.21%
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	99.67%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	14,996,193.51	23.43%
2	21 江门滨江 PPN001	债券	5,533,063.39	8.65%
3	22 周口城投 PPN001	债券	3,807,109.09	5.95%
4	20 仪征城发 PPN001	债券	2,239,230.83	3.50%
5	21 新昌投资 PPN001	债券	2,238,219.75	3.50%
6	18 咸宁城投 MTN002	债券	2,236,828.35	3.49%
7	20 鲁公 03	债券	2,233,367.75	3.49%
8	20 江门滨江 PPN001	债券	2,222,585.19	3.47%
9	20 溧开 04	债券	2,221,298.57	3.47%
10	20 桐庐国运 PPN002	债券	2,219,924.30	3.47%

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）
-	-	-	-	-

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

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。