

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 2 号

2022 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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 3 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 2 号
理财产品代码	21131002
A 份额销售代码	21131002A
B 份额销售代码	21131002B
产品登记编码	Z7003921000384
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	104.04%
产品起始日期	2021-10-27
产品终止日期	2022-10-26

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
2022-03-31	1.0212	500,000,000.00	1.0212	510,588,187.58	0.99%
2021-12-31	1.0112	500,000,000.00	1.0112	505,582,387.70	

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
2022-03-31	1.0212	335,130,674.00	1.0212	342,227,527.38	0.99%
2021-12-31	1.0112	335,130,674.00	1.0112	338,872,332.91	

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	4.96%	9.58%
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%	90.42%
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	95.04%	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。

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	现金及银行存款	现金及银行存款	84,960,076.41	9.58%
2	21 聚鑫 02	债券	22,043,102.15	2.48%
3	19 威中城	债券	19,551,289.12	2.20%
4	20 筑城 01	债券	19,285,169.05	2.17%
5	21 淮安国投 MTN001	债券	16,784,834.40	1.89%
6	19 国开 14	债券	13,251,335.15	1.49%
7	20 鄂路桥(疫情防控债)PPN001	债券	13,052,469.87	1.47%
8	21 江高 01	债券	12,632,593.22	1.42%
9	21 金阳 02	债券	12,567,745.59	1.42%
10	21 长湖债	债券	11,743,783.30	1.32%

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	买入规模（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	买入规模（元）
华夏银行股份有限公司	012280164.IB	22 东航 SCP003	1,466,237.74
华夏银行股份有限公司	102280116.IB	22 新郑投资 MTN001	1,026,366.42
华夏银行股份有限公司	102280588.IB	22 绵阳交通 MTN001	5,672,702.61

3.4.3 报告期内其他重大关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	交易金额（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

本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。报告期内无流动性风险事件发生。

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

本产品主要配置货币市场工具、利率债、同业存单和国企、央企城投债，信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生，价格波动可控。

5.2.2 产品股票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	10257000000857085

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。