

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 5 号

2022 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：2022 年 04 月 01 日至 2022 年 6 月 30 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 5 号
理财产品代码	21131005
A 份额销售代码	21131005A
B 份额销售代码	21131005B
产品登记编码	Z7003921000394
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	117.79%
产品起始日期	2021-12-07
产品终止日期	2022-09-13

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
2022-06-30	1.0208	200,422,027.00	1.0208	204,581,378.38	1.64%
2022-03-31	1.0043	200,422,027.00	1.0043	201,282,311.38	

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
2022-06-30	1.0210	96,336,500.00	1.0210	98,363,383.94	1.65%
2022-03-31	1.0044	96,336,500.00	1.0044	96,765,120.70	

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	10.33%	10.13%
2	同业存单	0.00%	2.27%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.20%
4	债券	0.00%	76.26%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	1.20%
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	1.21%	9.93%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	88.45%	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。

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	36,144,367.90	10.13%
2	21 邮储银行二级 01	债券	4,157,990.29	1.17%
3	20 日照城投 PPN001	债券	3,587,118.12	1.01%
4	19 文投 01	债券	3,531,038.37	0.99%
5	21 兴业银行二级 02	债券	3,472,678.45	0.97%
6	21 宜春 01	债券	3,298,372.46	0.92%
7	21 建设银行二级 03	债券	3,278,092.35	0.92%
8	20 华建 01	债券	3,009,381.28	0.84%
9	22 武新城	债券	2,999,506.34	0.84%
10	18 金隅 MTN003	债券	2,916,828.26	0.82%

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）
-	-	-	-

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）
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	40,000,000.00

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外部评级未出现下调，展望稳定，债券价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的权益仓位相对保守，价格波动对组合净值波动率的影响保持在可控范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000866066

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。