

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 9 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 9 号
理财产品代码	21131009
A 份额销售代码	21131009A
B 份额销售代码	21131009B
产品登记编码	Z7003921000398
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	100.49%
产品起始日期	2021-12-16
产品终止日期	2022-12-14

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	1.0228	438,523,389.00	1.0228	448,514,676.46	1.26%
2022-03-31	1.0101	438,523,389.00	1.0101	442,946,498.68	

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	1.0239	10,671,506.00	1.0239	10,926,371.71	1.31%
2022-03-31	1.0107	10,671,506.00	1.0107	10,785,345.58	

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	2.69%	3.11%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.36%
4	债券	0.00%	46.47%
5	非标准化债权类资产	43.52%	43.37%
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	5.30%	6.69%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	48.49%	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	太原重型机械集团有限公司 2021 年 度第二期债权融资计划	非标准化债权类 资产	200,267,200.44	43.37%
2	广发集丰 A	公募基金	19,202,071.93	4.16%
3	现金及银行存款	现金及银行存款	14,361,535.03	3.11%
4	19 绵阳投资 PPN001	债券	9,076,337.86	1.97%
5	16 迈瑞 03	债券	6,476,552.48	1.40%
6	20 株洲城建 PPN003	债券	6,135,820.57	1.33%
7	21 良渚 01	债券	6,081,592.09	1.32%
8	19 军融 02	债券	6,040,158.02	1.31%
9	21 晋资 02	债券	6,036,460.26	1.31%
10	21 桂投 01	债券	6,026,381.27	1.31%

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
1	太原重型机械集团有限公司	太原重型机械集团有限公司 2021年度第二期债权融资计划	债权融资计划	5.50	166	正常

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	012281485.IB	22 三一重工 SCP003	79,591.53

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

本产品为封闭型产品，产品持有较高比例的高流动性资产，报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控。

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。产品组合久期控制在 3 以内，价格波动水平较低，整体可控。

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。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000868246

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。