

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 33 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 33 号 |
| 理财产品代码 | 21131033 |
| A 份额销售代码 | 21131033A |
| B 份额销售代码 | 21131033B |
| 产品登记编码 | Z7003921000741 |
| 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 | 102.71% |
| 产品起始日期 | 2022-01-19 |
| 产品终止日期 | 2023-02-01 |

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 | 1.0158 | 1,694,175,453.00 | 1.0158 | 1,720,925,133.83 | 1.12% |
| 2022-03-31 | 1.0045 | 1,694,175,453.00 | 1.0045 | 1,701,850,954.69 | |

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 | 1.0147 | 136,439,606.00 | 1.0147 | 138,440,196.02 | 1.07% |
| 2022-03-31 | 1.0040 | 136,439,606.00 | 1.0040 | 136,991,117.57 | |

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 | 1.12% | 2.13% |
| 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% | 57.23% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 33.59% | 32.75% |
| 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 | 0.94% | 7.89% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 64.35% | 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 | 青岛西海岸新区融合控股集团有限公司 2022 年度第二期债权融资计划 | 非标准化债权类 资产 | 504,366,088.12 | 26.41% |
| 2 | 青岛西海岸新区融合控股集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划 | 非标准化债权类 资产 | 121,047,861.15 | 6.34% |
| 3 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 40,718,793.02 | 2.13% |
| 4 | 20 滨建 01 | 债券 | 37,794,922.14 | 1.98% |
| 5 | 21 拱墅 03 | 债券 | 36,757,340.93 | 1.92% |
| 6 | 富国双债增强债券 A | 公募基金 | 32,235,665.12 | 1.69% |
| 7 | 20 海尖 01 | 债券 | 31,077,558.69 | 1.63% |
| 8 | 20 豫资 03 | 债券 | 28,243,271.56 | 1.48% |
| 9 | G20 天成 2 | 债券 | 27,426,455.51 | 1.44% |
| 10 | 22 首股 02 | 债券 | 21,281,592.64 | 1.11% |

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 | 青岛西海岸新区融合控股集团有限公司 | 青岛西海岸新区融合控股集团有限公司2022年度第一期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.30 | 213 | 正常 |
| 2 | 青岛西海岸新区融合控股集团有限公司 | 青岛西海岸新区融合控股集团有限公司2022年度第二期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.30 | 213 | 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 | 2,394,528.42 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281597.IB | 22 长虹电子 SCP002 | 592,794.78 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281600.IB | 22 盐城国投 SCP002 | 1,630,185.64 |

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

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 | 10257000000878141 |

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。