

华夏理财固收纯债臻享封闭私募理财产品 1 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	华夏理财固收纯债臻享封闭私募理财产品 1 号
理财产品代码	21711001
产品登记编码	Z7003921A000001
产品募集方式	私募
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	100.13%
产品起始日期	2021-09-17
产品终止日期	2022-09-13

第二章 净值、存续规模及收益表现

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	1.0396	100,810,000.00	1.0396	104,803,566.75	1.32%
2022-03-31	1.0261	100,810,000.00	1.0261	103,445,870.30	

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	4.65%	4.92%
2	同业存单	0.00%	3.59%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.57%
4	债券	0.00%	89.92%
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	95.35%	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	16 武国资	债券	10,765,991.84	10.26%
2	20 国兴 01	债券	10,385,588.16	9.90%
3	19 兴信 01	债券	7,775,123.66	7.41%
4	20 连城 01	债券	7,698,053.69	7.34%
5	20 市北 01	债券	7,151,436.11	6.81%
6	21 渤海银行二级	债券	6,835,828.78	6.51%
7	20 乌高新 MTN003	债券	6,313,468.64	6.02%
8	20 淮安水利 PPN001	债券	5,809,567.76	5.54%
9	现金及银行存款	现金及银行存款	5,167,818.99	4.92%
10	22 江北建投 SCP003	债券	4,536,824.82	4.32%

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	012281379.IB	22 盐城国投 SCP001	920.14
华夏银行股份有限公司	012281597.IB	22 长虹电子 SCP002	692.31
华夏银行股份有限公司	012281600.IB	22 盐城国投 SCP002	1,903.85

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

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	10257000000871305

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。