

# 华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 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	华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 5 号
理财产品代码	21721005
A 份额销售代码	21721005A
B 份额销售代码	21721005B
产品登记编码	Z7003921A000008
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	114.60%
产品起始日期	2022-01-27
产品终止日期	2023-01-18

## 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	1.0169	500,000.00	1.0169	508,441.61	1.57%
2022-03-31	1.0012	500,000.00	1.0012	500,618.67	

### 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	1.0177	200,000,000.00	1.0177	203,548,238.49	1.61%
2022-03-31	1.0016	200,000,000.00	1.0016	200,316,638.02	

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	1.71%	4.53%
2	同业存单	0.00%	1.45%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.38%
4	债券	0.00%	74.46%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.89%
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%	18.30%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.29%	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	10,582,633.31	4.53%
2	19 文投 01	债券	5,321,540.73	2.28%
3	22 中远 3A	债券	4,019,208.26	1.72%
4	广发聚鑫 A	公募基金	3,596,606.05	1.54%
5	华宝现金添益 A	公募基金	3,578,089.69	1.53%
6	20 首致 01	债券	2,800,746.32	1.20%
7	21 邮储银行二级 01	债券	2,799,081.94	1.20%
8	20 淮投 01	债券	2,795,619.89	1.20%
9	20 光大嘉宝 MTN002	债券	2,762,889.95	1.18%
10	20 日照城投 PPN001	债券	2,414,781.38	1.03%

### 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	102281263.IB	22 即墨城投 MTN001	111,783.46

#### 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	15,000,000.00

#### 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	10257000000879869

## 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。