

华夏理财固定收益纯债型半年定开理财产品 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	华夏理财固定收益纯债型半年定开理财产品 1 号
理财产品代码	21113201
A 份额销售代码	21113201A
B 份额销售代码	21113201B
产品登记编码	Z7003921000461
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式
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	107.62%
产品起始日期	2021-11-23
产品终止日期	无特定存续期限

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	1.0245	1,444,374,549.25	1.0245	1,479,797,940.12	0.98%
2022-03-31	1.0146	503,773,214.00	1.0146	511,106,062.72	

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	1.0248	584,849,387.78	1.0248	599,374,152.21	1.01%
2022-03-31	1.0146	634,083,294.00	1.0146	643,312,916.70	

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	0.57%	11.91%
2	同业存单	0.00%	3.33%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.65%
4	债券	0.00%	82.81%
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	0.29%	1.30%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.14%	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	266,458,968.22	11.91%
2	22 浙滨开投 SCP001	债券	22,499,869.30	1.01%
3	20 上城 01	债券	21,301,456.35	0.95%
4	21 鲁能源 MTN007	债券	17,980,397.58	0.80%
5	21 首置 03	债券	17,751,876.86	0.79%
6	20 天成租赁 GN003	债券	16,413,493.84	0.73%
7	21 孝感 01	债券	15,919,306.76	0.71%
8	20 民生银行二级	债券	15,731,693.50	0.70%
9	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	14,612,643.36	0.65%
10	20 药租 01	债券	13,366,900.22	0.60%

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	1,786,843.22
华夏银行股份有限公司	012281597.IB	22 长虹电子 SCP002	739,891.42
华夏银行股份有限公司	012281600.IB	22 盐城国投 SCP002	323,771.91
华夏银行股份有限公司	032280609.IB	22 赣能源 PPN001	10,729,540.86
华夏银行股份有限公司	102280966.IB	22 国惠投资 MTN001A	288,806.61
华夏银行股份有限公司	102281333.IB	22 京电子城 MTN002	271,892.09

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）
英大保险资产管理有限 公司	YD-HLYJ OTC	英大资产活利壹玖 资产管理产品	买入	332,000,000.00

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

本产品对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前组合流动性风险可控。

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

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,但持仓中部分资产受市场原因主体评级有所调整。产品持仓 19 晋经 02 (162757.SH) 发行人山西省经济建设投资集团有限公司 2022 年 6 月主体评级被上海新世纪资信评估投资服务有限公司由 AA 下调至 AA-。

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	10257000000857018

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。