

# 华夏理财固定收益增强型 14 天定开理财产品 1 号

## 2022 年第 1 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 01 月 01 日至 2022 年 3 月 31 日

## 第一章 基本信息

|          |                            |
|----------|----------------------------|
| 产品名称     | 华夏理财固定收益增强型 14 天定开理财产品 1 号 |
| 理财产品代码   | 2119187301                 |
| A 份额销售代码 | 2119187301A                |
| B 份额销售代码 | 2119187301B                |
| C 份额销售代码 | 2119187301C                |
| 产品登记编码   | Z7003921000290             |
| 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     | 103.14%                    |
| 产品起始日期   | 2021-06-25                 |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-03-31 | 1.0357      | 107,963,015.55 | 1.0357      | 111,819,112.18 | 0.95%         |
| 2021-12-31 | 1.0260      | 115,493,209.90 | 1.0260      | 118,501,606.81 |               |

### B 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-03-31 | 1.0096      | 230,984,004.05 | 1.0096      | 233,211,883.54 | 0.91%         |
| 2021-12-31 | 1.0005      | 47,624,055.00  | 1.0005      | 47,647,640.08  |               |

### C 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2022-03-31 | 1.0016      | 25,749,000.00 | 1.0016      | 25,790,009.73 | 0.16%         |
| 2022-03-09 | 1.0000      | -             | 1.0000      | -             |               |

## 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       | 0.25%     | 4.25%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 1.73%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.04%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 92.96%    |
| 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%     | 1.01%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.75%    | 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------|---------|---------------|-------------|
| 1  | 19 金水 02       | 债券      | 22,862,204.81 | 5.98%       |
| 2  | 20 兴港 01       | 债券      | 22,517,077.63 | 5.89%       |
| 3  | 22 盐城资产 PPN001 | 债券      | 20,929,314.36 | 5.47%       |
| 4  | 20 鑫诚债         | 债券      | 14,312,906.07 | 3.74%       |
| 5  | G20 长交 1       | 债券      | 13,746,893.93 | 3.59%       |
| 6  | 19 军融 01       | 债券      | 12,293,475.65 | 3.21%       |
| 7  | 19 兴港 01       | 债券      | 11,881,768.78 | 3.11%       |
| 8  | 19 环球 03       | 债券      | 11,444,305.91 | 2.99%       |
| 9  | 21 淮水 01       | 债券      | 8,949,643.07  | 2.34%       |
| 10 | 现金及银行存款        | 现金及银行存款 | 8,887,707.57  | 2.32%       |

### 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 | 012280164.IB | 22 东航 SCP003   | 52,061.53  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280116.IB | 22 新郑投资 MTN001 | 45,005.96  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280588.IB | 22 绵阳交通 MTN001 | 363,336.53 |

#### 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）       |
|------------------|----------------|--------------------|------|---------------|
| 英大保险资产管理有限<br>公司 | YD-HLYJ<br>OTC | 英大资产活利壹玖<br>资产管理产品 | 买入   | 64,000,000.00 |

## 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

本产品为定期开放型产品，产品持有现金及剩余期限一年内的利率债比例不低于 5%，同时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 | 10257000000867004 |

## 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。