

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 9 号

## 2022 年第 3 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 07 月 01 日至 2022 年 09 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 9 号 |
| 理财产品代码   | 21131009               |
| A 份额销售代码 | 21131009A              |
| B 份额销售代码 | 21131009B              |
| 产品登记编码   | Z7003921000398         |
| 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     | 102.17%                |
| 产品起始日期   | 2021-12-16             |
| 产品终止日期   | 2022-12-14             |

## 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0318      | 438,523,389.00 | 1.0318      | 452,451,492.52 | 0.88%         |
| 2022-06-30 | 1.0228      | 438,523,389.00 | 1.0228      | 448,514,676.46 |               |

### 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0334      | 10,671,506.00 | 1.0334      | 11,027,834.78 | 0.93%         |
| 2022-06-30 | 1.0239      | 10,671,506.00 | 1.0239      | 10,926,371.71 |               |

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       | 0.95%     | 1.00%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.21%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 51.45%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 43.12%    | 42.30%    |
| 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          | 5.13%     | 5.03%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 50.81%    | 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  | 太原重型机械集团有限公司 2021 年<br>度第二期债权融资计划 | 非标准化债权类<br>资产 | 200,302,859.44 | 42.30%      |
| 2  | 广发集丰 A                            | 公募基金          | 18,872,497.07  | 3.99%       |
| 3  | 19 绵阳投资 PPN001                    | 债券            | 10,109,204.09  | 2.13%       |
| 4  | 16 迈瑞 03                          | 债券            | 6,767,043.49   | 1.43%       |
| 5  | 21 良渚 01                          | 债券            | 6,713,043.11   | 1.42%       |
| 6  | 21 桂投 01                          | 债券            | 6,636,985.02   | 1.40%       |
| 7  | 21 晋资 02                          | 债券            | 6,614,383.47   | 1.40%       |
| 8  | 20 城发 01                          | 债券            | 6,575,214.38   | 1.39%       |
| 9  | 20 世园 01                          | 债券            | 6,455,938.51   | 1.36%       |
| 10 | 20 株洲城建 PPN003                    | 债券            | 6,436,818.65   | 1.36%       |

### 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  | 太原重型机械集团有限公司 | 太原重型机械集团有限公司<br>2021 年度第二期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.50   | 74      | 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 | 042280372.IB | 22 武清国资 CP004        | 18,202.63  |
| 华夏银行股份有限公司 | 092280061.IB | 22 长沙农商行二级资本<br>债 01 | 919,570.80 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002       | 225,293.47 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281971.IB | 22 桂铁投 MTN005        | 209,112.52 |

#### 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 | 10257000000868246 |

## **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。