

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 20 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 20 号 |
| 理财产品代码   | 21131020                |
| A 份额销售代码 | 21131020A               |
| B 份额销售代码 | 21131020B               |
| 产品登记编码   | Z7003921000404          |
| 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     | 108.55%                 |
| 产品起始日期   | 2021-12-23              |
| 产品终止日期   | 2023-01-04              |

## 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 | 1.0161      | 190,241,022.00 | 1.0161      | 193,295,006.15 | 0.07%         |
| 2022-06-30 | 1.0154      | 190,241,022.00 | 1.0154      | 193,178,921.02 |               |

### 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 | 1.0176      | 4,374,110.00 | 1.0176      | 4,451,176.67 | 0.11%         |
| 2022-06-30 | 1.0165      | 4,374,110.00 | 1.0165      | 4,446,261.56 |               |

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       | 2.27%     | 2.79%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 3.07%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 2.22%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 38.79%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 47.23%    | 43.57%    |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 5.73%     |
| 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%     | 3.83%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 50.51%    | 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  | 漳州市交通发展集团有限公司理财<br>融资项目 | 非标准化债权类<br>资产   | 93,528,982.43 | 43.57%      |
| 2  | 现金及银行存款                 | 现金及银行存款         | 5,996,426.09  | 2.79%       |
| 3  | 债券买入返售                  | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 4,765,032.72  | 2.22%       |
| 4  | 21 国新 03                | 债券              | 1,871,556.25  | 0.87%       |
| 5  | 诺安优化收益债券                | 公募基金            | 1,549,044.12  | 0.72%       |
| 6  | 20 济城 G1                | 债券              | 1,528,535.08  | 0.71%       |
| 7  | 21 附息国债 05              | 债券              | 1,397,230.58  | 0.65%       |
| 8  | 19 常高 06                | 债券              | 1,152,786.62  | 0.54%       |
| 9  | 20 民生银行二级               | 债券              | 1,112,228.00  | 0.52%       |
| 10 | 诺安双利债券发起式               | 公募基金            | 947,089.96    | 0.44%       |

### 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  | 漳州市交通发展集团有限公司 | 漳州市交通发展集团有限公司理财融资项目 | 信托贷款 | 5.79   | 87      | 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）   |
|-------------------|--------------|-----------------|-----------|
| 北京科技园建设（集团）股份有限公司 | 032200226.IB | 22 京科技园 PPN001A | 10,617.91 |
| 鲁能集团有限公司          | 137819.SH    | 22 鲁能 02        | 16,962.09 |

#### 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 | 012283126.IB | 22 新疆金投 SCP002 | 17,076.32 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032280716.IB | 22 连云城建 PPN004 | 67,253.93 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042280372.IB | 22 武清国资 CP004  | 9,801.94  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002 | 8,329.64  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281789.IB | 22 武汉生态 MTN002 | 35,027.32 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281864.IB | 22 豫投资 MTN002  | 96,077.04 |

#### 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

本产品以债券等固收类资产为主要投资标的，追求稳健回报，同时精选权益基金，为组合谋求收益增强。

本产品固收部分主要投向资管计划以及债券，同时根据市场行情变化，动态调整相关资产的比例，平衡产品投资收益以及流动性。穿透资管计划，本产品投资的资管计划底层债券资产以 AA 以上评级债券为主，品种上以城投债以及国有企业债券为主。本产品权益部分主要投向资产管理计划以及权益型、混合型公募基金和 FOF 产品，通过自上而下和中观行业策略，结合基金评价和精选策略，努力控制产品净值回撤，力争获取超额收益。

本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，做好流动性管理。

### 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总体资质较优，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

截止本报告日，产品投资的权益类资产受市场波动影响，出现一定回调，产品严格按照产品说明书约定，灵活进行了仓位调整，产品净值波动较低。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

## 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号              |
|----|------|-------------------|
| 1  | 托管账户 | 10257000000873573 |

## 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。