

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 24 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 24 号 |
| 理财产品代码  | 21131024                |
| 产品登记编码  | Z7003921000737          |
| 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    | 113.03%                 |
| 产品起始日期  | 2022-04-07              |
| 产品终止日期  | 2023-04-04              |

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

| 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 | 1.0244      | 503,160,164.00 | 1.0244      | 515,442,858.06 | 1.18%         |
| 2022-06-30 | 1.0125      | 503,160,164.00 | 1.0125      | 509,462,937.49 |               |

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       | 1.40%     | 1.91%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 3.71%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.04%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 68.13%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 21.74%    | 19.25%    |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 0.63%     |
| 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%     | 6.34%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 76.86%    | 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  | 青岛海发国有资本投资运营集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划 | 非标准化债权类资产 | 112,121,001.70 | 19.25%      |
| 2  | 现金及银行存款                             | 现金及银行存款   | 11,139,343.78  | 1.91%       |
| 3  | 19 民生银行永续债                          | 债券        | 3,991,147.17   | 0.69%       |
| 4  | 民生优 1                               | 权益类投资     | 3,664,847.37   | 0.63%       |
| 5  | 22 国海 02                            | 债券        | 3,288,448.11   | 0.56%       |
| 6  | 国泰合融纯债                              | 公募基金      | 2,803,293.61   | 0.48%       |
| 7  | 景顺长城景泰裕利纯债                          | 公募基金      | 2,695,246.03   | 0.46%       |
| 8  | 19 农业银行永续债 01                       | 债券        | 2,615,413.52   | 0.45%       |
| 9  | 19 广发银行永续债                          | 债券        | 2,611,239.24   | 0.45%       |
| 10 | 21 光穗广开 ABN001 优先                   | 债券        | 2,574,552.09   | 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  | 青岛海发国有资本投资运营集团有限公司 | 青岛海发国有资本投资运营集团有限公司2022年度第一期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.30   | 182     | 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）   |
|----------|-----------|----------|-----------|
| 鲁能集团有限公司 | 137819.SH | 22 鲁能 02 | 90,122.37 |

#### 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 | 241,135.46 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002 | 142,555.81 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281669.IB | 22 武汉生态 MTN001 | 246,484.44 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281789.IB | 22 武汉生态 MTN002 | 652,574.54 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281971.IB | 22 桂铁投 MTN005  | 349,267.59 |

#### 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**

由于产品存续期内，客户无提前终止权，不可赎回本期产品，故投资组合流动性风险较低。

### **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**

截至本报告日，产品投资的权益资产价格波动处于市场合理区间范围内。

#### **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 | 10257000000878323 |

## **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。