

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 56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 56 号
理财产品代码	22131056
A 份额销售代码	22131056A
B 份额销售代码	22131056B
C 份额销售代码	22131056C
D 份额销售代码	22131056D
产品登记编码	Z7003922000041
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	113.60%
产品起始日期	2022-05-11
产品终止日期	2023-06-06

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
2022-09-30	1.0167	206,460,325.00	1.0167	209,914,115.84	1.14%
2022-06-30	1.0052	206,460,325.00	1.0052	207,542,517.24	

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
2022-09-30	1.0167	151,480,390.00	1.0167	154,014,443.89	1.14%
2022-06-30	1.0052	151,480,390.00	1.0052	152,274,396.89	

C 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
2022-09-30	1.0161	79,068,875.00	1.0161	80,344,691.71	1.10%
2022-06-30	1.0050	79,068,875.00	1.0050	79,466,997.37	

D 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
2022-09-30	1.0157	122,626,091.00	1.0157	124,556,263.95	1.07%
2022-06-30	1.0049	122,626,091.00	1.0049	123,226,649.53	

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	0.63%	2.22%
2	同业存单	0.00%	1.18%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.23%
4	债券	0.00%	92.93%
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%	3.43%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.37%	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	14,353,064.63	2.22%
2	22 付息国债 19	债券	6,934,174.71	1.07%
3	交银稳利中短债 A	公募基金	6,083,271.83	0.94%
4	22 宁波银行二级资本债 01	债券	5,999,226.74	0.93%
5	22 河钢集 MTN001	债券	5,827,483.92	0.90%
6	21 华发 01	债券	5,081,264.62	0.79%
7	21 华租 03	债券	4,775,539.99	0.74%
8	19 威中城	债券	4,725,933.91	0.73%
9	21 农发 02	债券	4,046,290.62	0.63%
10	20 淮发 02	债券	4,011,237.03	0.62%

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	012283126.IB	22 新疆金投 SCP002	198,693.67
华夏银行股份有限公司	102281527.IB	22 长发集团 MTN002	123,635.34

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本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

截止本报告日，本产品投资的债券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，本产品无股票持仓。

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	10257000000886855

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。