

# 华夏理财固定收益增强型三个月定开理财 产品 2 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三个月定开理财产品 2 号 |
| 理财产品代码  | 211918700202             |
| 产品登记编码  | Z7003921000005           |
| 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    | 115.03%                  |
| 产品起始日期  | 2021-06-24               |
| 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

| 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 | 1.0477      | 191,913,898.50 | 1.0477      | 201,063,410.72 | 0.75%         |
| 2022-06-30 | 1.0399      | 367,278,771.98 | 1.0399      | 381,915,760.59 |               |

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       | 9.80%     | 18.59%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 12.48%    |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.17%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 58.33%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 0.78%     |
| 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%     | 9.66%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 90.20%    | 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  | 现金及银行存款        | 现金及银行存款 | 26,971,710.18 | 11.66%      |
| 2  | 海富通中证短融 ETF    | 公募基金    | 7,361,383.30  | 3.18%       |
| 3  | 22 附息国债 10     | 债券      | 4,322,374.03  | 1.87%       |
| 4  | 19 启东 03       | 债券      | 4,129,954.03  | 1.79%       |
| 5  | 泰信天天收益 B       | 公募基金    | 3,694,782.79  | 1.60%       |
| 6  | 20 衡阳城投 PPN003 | 债券      | 3,296,398.08  | 1.43%       |
| 7  | 20 国开 02       | 债券      | 3,092,778.83  | 1.34%       |
| 8  | 21 广州银行二级      | 债券      | 3,056,008.12  | 1.32%       |
| 9  | 19 中国银行二级 03   | 债券      | 2,856,552.92  | 1.24%       |
| 10 | 国投瑞银钱多宝货币 A    | 公募基金    | 2,432,828.43  | 1.05%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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）   |
|----------|-----------|----------|-----------|
| 鲁能集团有限公司 | 137819.SH | 22 鲁能 02 | 11,812.03 |

#### 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 | 11,899.29    |
| 华夏银行股份有限公司 | 032200240.IB | 22 徐州经开 PPN002 | 3,492,096.87 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102200189.IB | 22 知识城 MTN006  | 1,405,930.12 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002 | 660,128.81   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281669.IB | 22 武汉生态 MTN001 | 35,670.64    |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281789.IB | 22 武汉生态 MTN002 | 40,972.21    |

#### 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。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，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

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 | 10257000000858250 |

## **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。