

# 华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 15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	华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 15 号
理财产品代码	21721015
产品登记编码	Z7003921A000019
产品募集方式	私募
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	113.13%
产品起始日期	2022-05-26
产品终止日期	2022-11-30

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

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	1.0142	350,000,000.00	1.0142	354,975,382.06	1.30%
2022-06-30	1.0012	350,000,000.00	1.0012	350,404,252.95	

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	1.30%	3.72%
2	同业存单	0.00%	0.56%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.15%
4	债券	0.00%	89.58%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	3.02%
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%	2.97%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.70%	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	14,955,446.89	3.72%
2	平银优 01	权益类投资	12,120,351.48	3.02%
3	19 徽商银行永续债	债券	6,147,560.38	1.53%
4	20 恒丰银行永续债	债券	5,383,207.54	1.34%
5	22 建发集 MTN002	债券	5,228,703.00	1.30%
6	22 青岛银行永续债 02	债券	5,110,684.15	1.27%
7	22 晋能装备 MTN006	债券	4,160,118.21	1.04%
8	21 北京银行永续债 01	债券	4,147,270.91	1.03%
9	交银稳利中短债 A	公募基金	4,075,988.45	1.01%
10	22 建发集 MTN003	债券	3,904,441.96	0.97%

### 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	87,928.58
华夏银行股份有限公司	102281527.IB	22 长发集团 MTN002	131,467.34
华夏银行股份有限公司	102281789.IB	22 武汉生态 MTN002	361,018.11
华夏银行股份有限公司	102281971.IB	22 桂铁投 MTN005	155,064.16

#### 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）
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	4,100,000.00

## 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。本产品将根据到期情况，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	10257000000883796

## 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。