

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 2 号

## 2022 年半年度报告

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 01 月 01 日至 2022 年 6 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 2 号 |
| 理财产品代码   | 21131002               |
| A 份额销售代码 | 21131002A              |
| B 份额销售代码 | 21131002B              |
| 产品登记编码   | Z7003921000384         |
| 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     | 103.74%                |
| 产品起始日期   | 2021-10-27             |
| 产品终止日期   | 2022-10-26             |

## 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-06-30 | 1.0365      | 500,000,000.00 | 1.0365      | 518,259,560.14 | 2.50%         |
| 2021-12-31 | 1.0112      | 500,000,000.00 | 1.0112      | 505,582,387.70 |               |

### 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-06-30 | 1.0365      | 335,130,674.00 | 1.0365      | 347,369,351.76 | 2.50%         |
| 2021-12-31 | 1.0112      | 335,130,674.00 | 1.0112      | 338,872,332.91 |               |

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       | 0.96%     | 1.52%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 97.57%    |
| 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          | 0.94%     | 0.91%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 98.10%    | 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  | 22 首股 02            | 债券      | 30,643,802.55 | 3.41%       |
| 2  | 21 聚鑫 02            | 债券      | 20,465,710.85 | 2.28%       |
| 3  | 19 国开 14            | 债券      | 20,148,233.14 | 2.24%       |
| 4  | 19 威中城              | 债券      | 17,929,917.38 | 2.00%       |
| 5  | 20 筑城 01            | 债券      | 17,136,101.83 | 1.91%       |
| 6  | 21 淮安国投 MTN001      | 债券      | 15,431,541.52 | 1.72%       |
| 7  | 现金及银行存款             | 现金及银行存款 | 13,644,085.29 | 1.52%       |
| 8  | 20 鄂路桥(疫情防控债)PPN001 | 债券      | 12,006,271.61 | 1.34%       |
| 9  | 21 金阳 02            | 债券      | 11,686,170.39 | 1.30%       |
| 10 | 21 江高 01            | 债券      | 11,176,439.80 | 1.24%       |

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） |
|-------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -       |

**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 | 012280164.IB | 22 东航 SCP003   | 1,466,237.74 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281485.IB | 22 三一重工 SCP003 | 1,111,031.41 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281597.IB | 22 长虹电子 SCP002 | 871,885.87   |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281600.IB | 22 盐城国投 SCP002 | 2,397,686.16 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280116.IB | 22 新郑投资 MTN001 | 1,026,366.42 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280588.IB | 22 绵阳交通 MTN001 | 5,672,702.61 |

**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**

报告期内无流动性风险事件发生。

### **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**

本产品主要配置货币市场工具、利率债、同业存单和国企、央企及城投债，信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生，价格波动可控。

#### **5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况**

无。

#### **5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况**

无。

## 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号              |
|----|------|-------------------|
| 1  | 托管账户 | 10257000000857085 |

## 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。

## 第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品  
在投资运作过程中存在违反法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。