

yin

# 华夏理财固定收益增强型一年定开理财产品 1号

## 2021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：2021年07月01日至2021年9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一年定开理财产品 1 号
理财产品代码	211918700301
产品登记编码	Z7003921000002
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(稳健型)
杠杆水平	113.78%
产品起始日期	2021-03-23
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 (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
2021-09-30	1.0256	1,994,821,456.00	1.0256	2,045,910,466.76	1.29%
2021-06-30	1.0125	1,994,821,456.00	1.0125	2,019,772,684.28	

## 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	1.08%	1.25%
2	同业存单	0.00%	8.22%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.15%
4	债券	0.00%	72.92%
5	非标准化债权类资产	14.67%	12.90%
6	权益类投资	0.00%	0.02%
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%	3.53%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	84.25%	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	山东汇通金融融资租赁股份有限公司同业借款理财投融资项目	非标准化债权类 资产	300,365,250.00	12.90%
2	现金及银行存款	现金及银行存款	29,204,301.28	1.25%
3	15 农发 04	债券	22,029,643.81	0.95%
4	19 民生银行永续债	债券	20,393,541.94	0.88%
5	19 广发银行永续债	债券	12,286,482.66	0.53%
6	21 国开 01	债券	11,146,604.36	0.48%
7	20 晋电 02	债券	10,758,112.00	0.46%
8	20 民生银行二级	债券	10,640,455.47	0.46%
9	21 平安银行 CD093	同业存单	10,380,099.75	0.45%
10	21 江苏银行 CD038	同业存单	9,969,554.95	0.43%

### 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	山东汇通金融租赁有限公司	山东汇通金融租赁有限公司 同业借款	同业借款	4.87%	171	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）
-	-	-	-

#### 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	012103425.IB	21 云南世博 SCP002	1,160,244.07
华夏银行股份有限公司	032100868.IB	21 吴兴城投 PPN002	261,396.85

#### 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

流动性风险管理方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金、正逆回购及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是产品持有一定比例的高流动性资产，赎回期内主要通过正回购操作或卖出部分资产变现，满足产品的流动性需求。

### 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外部评级未出现下调，展望稳定，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无负面信息，展望稳定，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	10257000000857664

## 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。