

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 12 号

2022 年第 4 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 10 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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 12 号
理财产品代码	21131012
A 份额销售代码	21131012A
B 份额销售代码	21131012B
产品登记编码	Z7003921000386
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	115.12%
产品起始日期	2021-09-15
产品终止日期	2023-03-20

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
2022-12-31	1.0368	245,250,599.00	1.0368	254,284,610.36	0.28%
2022-09-30	1.0339	245,250,599.00	1.0339	253,554,483.48	

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
2022-12-31	1.0382	91,360,444.00	1.0382	94,848,346.95	0.32%
2022-09-30	1.0349	91,360,444.00	1.0349	94,552,174.49	

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	0.28%	4.66%
2	同业存单	0.00%	1.03%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.21%
4	债券	0.00%	46.29%
5	非标准化债权类资产	46.69%	40.64%
6	权益类投资	0.00%	6.14%
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%	1.02%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	53.03%	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	晋能控股装备集团有限公司 2021 年度第四期债权融资计划	非标准化债权类资产	163,356,469.92	40.64%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	18,720,730.31	4.66%
3	21 拱墅 03	债券	4,381,675.58	1.09%
4	21 合建投 MTN002	债券	3,428,851.13	0.85%
5	G20 天成 2	债券	3,280,122.26	0.82%
6	21 国新 03	债券	2,857,914.32	0.71%
7	22 郎川债	债券	2,557,684.68	0.64%
8	22 东津 02	债券	2,538,816.66	0.63%
9	同和药业	权益类投资	2,411,430.08	0.60%
10	20 济城 G1	债券	2,396,824.83	0.60%

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	晋能控股装备集团有限公司	晋能控股装备集团有限公司 2021 年度第四期债权融资计划	债权融资计划	7.10	75	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	102282474.IB	22 株国投 MTN002	66,133.09

3.4.3 报告期内其他关联交易

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	ZC1A34 OTC	中诚信托汇鑫 15 号 集合资金信托计划	买入	10,000,000.00

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

本产品对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类、权益类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前组合流动性风险可控。

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

本产品持有债券资产信用展望稳定,四季度债券收益率有所上行,整体波动率在合理区间范围内。

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

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	10257000000857121

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。