

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 24 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 24 号
理财产品代码	21131024
产品登记编码	Z7003921000737
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	129.02%
产品起始日期	2022-04-07
产品终止日期	2023-04-04

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
2022-12-31	1.0175	503,160,164.00	1.0175	511,954,409.75	-0.67%
2022-09-30	1.0244	503,160,164.00	1.0244	515,442,858.06	

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	1.66%	1.83%
2	同业存单	0.00%	1.25%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.14%
4	债券	0.00%	77.61%
5	非标准化债权类资产	21.89%	16.98%
6	权益类投资	0.00%	0.75%
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%	1.44%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	76.45%	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	青岛海发国有资本投资运营集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	112,140,744.78	16.98%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	12,059,992.28	1.83%
3	19 民生银行永续债	债券	5,361,807.25	0.81%
4	民生优 1	权益类投资	4,729,261.32	0.72%
5	22 国海 02	债券	3,686,034.78	0.56%
6	19 农业银行永续债 01	债券	3,532,294.46	0.53%
7	19 广发银行永续债	债券	3,519,349.10	0.53%
8	22 海恒 K2	债券	3,288,809.97	0.50%
9	易方达恒久 1 年定期债券 A	公募基金	2,892,345.66	0.44%
10	21 光穗广开 ABN001 优先	债券	2,823,160.25	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	青岛海发国有资本投资运营集团有限公司	青岛海发国有资本投资运营集团有限公司2022年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.30	90	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	192,186.85

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）
-	-	-	-	-

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

由于产品存续期内，客户无提前终止权，不可赎回本期产品，故投资组合流动性风险较低。

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

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	10257000000878323

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。