

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 29 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 29 号
理财产品代码	22131029
A 份额销售代码	22131029A
B 份额销售代码	22131029B
C 份额销售代码	22131029C
产品登记编码	Z7003922000012
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	139.30%
产品起始日期	2022-03-02
产品终止日期	2023-03-07

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	1.0131	1,452,287,249.00	1.0131	1,471,300,666.32	-0.85%
2022-09-30	1.0218	1,452,287,249.00	1.0218	1,483,913,455.83	

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	1.0110	384,620,738.00	1.0110	388,845,198.70	-0.91%
2022-09-30	1.0203	384,620,738.00	1.0203	392,425,819.20	

C 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	1.0127	288,783,306.00	1.0127	292,441,853.62	-0.86%
2022-09-30	1.0215	288,783,306.00	1.0215	294,986,001.63	

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	2.27%	2.23%
2	同业存单	0.00%	3.56%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.35%
4	债券	0.00%	81.59%
5	非标准化债权类资产	11.85%	8.52%
6	权益类投资	0.00%	2.54%
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%	0.20%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	85.88%	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	长沙金洲新城投资控股集团有限公司非标理财融资项目	非标准化债权类资产	255,459,349.15	8.52%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	66,819,283.90	2.23%
3	20 衡阳城投 PPN003	债券	40,823,795.20	1.36%
4	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	40,613,064.32	1.35%
5	19 武汉城投 PPN001	债券	37,838,461.97	1.26%
6	21 广州银行二级	债券	36,939,510.38	1.23%
7	19 锡交通 PPN001	债券	24,343,572.09	0.81%
8	20 乐山国资 PPN002	债券	20,797,575.75	0.69%
9	20 赣版 01	债券	19,923,030.20	0.66%
10	19 北汽 06	债券	19,831,289.76	0.66%

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	长沙金洲新城投资控股集团有限公司	长沙金洲新城投资控股集团有限公司非标理财融资项目	信托贷款	5.90	62	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	102282472.IB	22 胶州湾 MTN002	276,252.82
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	1,030,432.92

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）
英大基金管理 有限公司	650952 OTC	英大基金-华英稳健 3号集合资产管理计 划	买入	3,900,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19KY OTC	中诚信托汇鑫 11 号 集合资金信托计划	买入	27,800,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19KZ OTC	中诚信托嘉信配置 1 号集合资金信托计 划	买入	12,900,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19L1 OTC	中诚信托嘉信配置 2 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,成立以来债券收益率震荡向下,整体波动率仍处在合理区间范围内。

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	10257000000881959

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。