

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 36 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 36 号
理财产品代码	22131036
A 份额销售代码	22131036A
B 份额销售代码	22131036B
C 份额销售代码	22131036C
D 份额销售代码	22131036D
E 份额销售代码	22131036E
产品登记编码	Z7003922000038
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	149.69%
产品起始日期	2022-04-26
产品终止日期	2023-05-23

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	1.0038	370,909,631.00	1.0038	372,303,502.73	-1.60%
2022-09-30	1.0201	370,909,631.00	1.0201	378,351,096.89	

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	1.0034	66,076,427.00	1.0034	66,302,122.34	-1.61%
2022-09-30	1.0198	66,076,427.00	1.0198	67,387,609.01	

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	1.0027	199,180,104.00	1.0027	199,724,142.13	-1.64%
2022-09-30	1.0194	199,180,104.00	1.0194	203,045,172.18	

D 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	1.0020	1,150,846,722.00	1.0020	1,153,203,163.73	-1.67%
2022-09-30	1.0190	1,150,846,722.00	1.0190	1,172,674,318.76	

E 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	1.0038	577,262,211.00	1.0038	579,431,552.07	-1.60%
2022-09-30	1.0201	577,262,211.00	1.0201	588,843,676.51	

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	0.07%	0.31%
2	同业存单	0.00%	0.96%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.49%
4	债券	0.00%	94.69%
5	非标准化债权类资产	3.92%	2.62%
6	权益类投资	0.00%	0.42%
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%	0.51%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	96.00%	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	长兴港通建设开发有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	68,092,281.59	1.92%
2	济南章丘控股集团有限公司理财投融资项目(渤海金雀 97)0511	非标准化债权类资产	25,038,859.98	0.71%
3	21 华租 03	债券	21,060,670.37	0.59%
4	22 西永 PPN001	债券	20,912,292.79	0.59%
5	20 民生银行二级	债券	20,199,911.84	0.57%
6	22 河钢集 MTN001	债券	20,049,307.87	0.56%
7	22 宿州城投 PPN001	债券	19,981,854.00	0.56%
8	21 住开 02	债券	19,367,272.72	0.55%
9	22 济南轨交 MTN001	债券	18,289,631.28	0.52%
10	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	17,447,809.20	0.49%

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	长兴港通建设开发有限公司	长兴港通建设开发有限公司2022年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.50	114	正常
2	济南章丘控股集团有限公司	济南章丘控股集团有限公司理财投融资项目(渤海金雀97)0511	信托贷款	5.70	131	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	102282373.IB	22 鹤壁投资 MTN003	279,336.76
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	2,081,248.26

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	ydhywj02 OTC	英大基金-华英稳健 2号集合资产管理计 划	买入	40,000,000.00

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，做好流动性管理。

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

截止本报告日，本产品投资的债券资产市场价格波动处于合理区间范围内。

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

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000886287

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。