

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 2 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	华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 2 号
理财产品代码	21121002
A 份额销售代码	21121002A
B 份额销售代码	21121002B
C 份额销售代码	21121002C
D 份额销售代码	21121002D
F 份额销售代码	21121002F
J 份额销售代码	21121002J
产品登记编码	Z7003921000308
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	125.84%
产品起始日期	2022-06-23
产品终止日期	2023-07-18

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	1.0076	223,760,985.00	1.0076	225,466,683.28	-0.42%
2022-09-30	1.0118	223,760,985.00	1.0118	226,402,335.63	

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	1.0076	260,375,486.00	1.0076	262,360,291.40	-0.42%
2022-09-30	1.0118	260,375,486.00	1.0118	263,449,046.53	

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	1.0068	211,542,483.00	1.0068	212,987,801.14	-0.45%
2022-09-30	1.0114	211,542,483.00	1.0114	213,952,548.23	

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	1.0063	520,036,529.00	1.0063	523,315,658.93	-0.47%
2022-09-30	1.0111	520,036,529.00	1.0111	525,818,588.49	

F 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	1.0074	13,880,658.00	1.0074	13,982,809.40	-0.43%
2022-09-30	1.0117	13,880,658.00	1.0117	14,042,605.64	

J 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	1.0076	528,100,738.00	1.0076	532,126,374.97	-0.42%
2022-09-30	1.0118	528,100,738.00	1.0118	534,334,618.24	

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	0.22%	0.38%
2	同业存单	0.00%	0.81%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.14%
4	债券	0.00%	66.71%
5	非标准化债权类资产	40.10%	31.91%
6	权益类投资	0.00%	0.00%
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%	0.05%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	59.68%	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	厦门信托.嵊州市交通投资发展集团有限公司理财融资项目	非标准化债权类资产	510,553,714.47	22.92%
2	粤财信托.海安开发区建设投资有限公司理财投融资项目(瑞丰 38 号)717 到期	非标准化债权类资产	200,178,199.86	8.99%
3	21 华租 03	债券	12,431,618.06	0.56%
4	20 赣版 01	债券	12,002,004.56	0.54%
5	19 北汽 06	债券	11,946,738.41	0.54%
6	21 泛悦优	债券	10,222,274.35	0.46%
7	22 河钢集 MTN001	债券	9,870,542.70	0.44%
8	20 京供销 MTN001	债券	9,869,572.32	0.44%
9	20 电建 A	债券	9,764,976.18	0.44%
10	20 桂交 01	债券	9,667,124.48	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	嵊州市交通投资发展集团有限公司	厦门信托.嵊州市交通投资发展集团有限公司理财融资项目	信托贷款	5.11	181	正常
2	海安开发区建设投资有限公司	粤财信托.海安开发区建设投资有限公司理财投融资项目(瑞丰 38 号)717 到期	信托贷款	4.62	198	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	928,303.56

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

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 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，无权益持仓。

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	10257000000870979

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。