

华夏理财权益打新周期360天理财产品A款

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	华夏理财权益打新周期 360 天理财产品 A 款
理财产品代码	2119487001
产品登记编码	Z7003921000300
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式
产品投资性质	权益类
投资及收益币种	人民币
产品风险评级	PR4 级（中高风险）
杠杆水平	100.07%
产品起始日期	2021-06-24
产品终止日期	无特定存续期限

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	1.0100	68,590,839.85	1.0100	69,274,198.35	-0.62%
2022-09-30	1.0163	81,251,956.70	1.0163	82,572,338.21	

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	4.87%	6.37%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	6.88%
4	债券	0.00%	20.09%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	5.09%
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	0.01%	61.57%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	95.12%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	4,769,492.48	6.88%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	4,417,201.79	6.37%
3	交银多策略回报灵活配置混合 A	公募基金	2,910,197.82	4.20%
4	交银周期回报灵活配置混合 A	公募基金	2,647,240.40	3.82%
5	22 太仓城发 PPN001	债券	2,085,688.19	3.01%
6	中欧瑾通灵活配置混合 A	公募基金	1,913,854.12	2.76%
7	浦发转债	债券	1,573,110.88	2.27%
8	交银优择回报灵活配置混合 A	公募基金	1,570,902.12	2.27%
9	华夏上证 50ETF	公募基金	1,539,600.34	2.22%
10	安信稳健增利混合 A	公募基金	1,524,021.97	2.20%

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
-	-	-	-	-	-	-

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）
-	-	-	-

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	650959 OTC	英大基金-华英价值 2号集合资产管理计 划	买入	19,000,000.00

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,按照产品说明书约定确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例,并随着风险收益特征的相对变化及时调整;此外,本产品通过分散投资、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。

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

本产品按照产品说明书约定的范围进行投资,并根据市场行情,调整各类资产的占比。结合产品所投资公募基金的持仓情况,由于产品固定收益类资产配置占比低于 20%,期间受债市大跌影响较小。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品严格按照产品说明书约定进行资产配置,四季度在股票市场及债券市场极其不利的情况下,依靠主动择时能力和选基能力,净值下跌相对较小。

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	10257000000863702

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。