

华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 26 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	华夏理财固定收益纯债型封闭式理财产品 26 号
理财产品代码	21111026
A 份额销售代码	21111026A
C 份额销售代码	21111026C
产品登记编码	Z7003921000729
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	138.79%
产品起始日期	2022-06-01
产品终止日期	2023-05-31

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	0.9993	102,876,916.00	0.9993	102,808,847.62	-1.49%
2022-09-30	1.0144	102,876,916.00	1.0144	104,358,072.27	

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	0.9979	50,000,000.00	0.9979	49,894,073.13	-1.55%
2022-09-30	1.0136	50,000,000.00	1.0136	50,677,855.65	

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	2.21%	1.92%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.02%
4	债券	0.00%	96.79%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
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%	1.26%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	97.79%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	4,078,899.50	1.92%
2	20 赣版 01	债券	2,403,953.20	1.13%
3	19 北汽 06	债券	2,392,883.61	1.13%
4	22 中海企业 MTN004	债券	2,088,010.23	0.99%
5	22 国海 02	债券	1,769,708.33	0.84%
6	19 江东控股 MTN001	债券	1,681,692.47	0.79%
7	19 武汉城投 PPN001	债券	1,572,000.46	0.74%
8	20 民生银行二级	债券	1,396,249.30	0.66%
9	20 财达 C1	债券	1,394,358.00	0.66%
10	20 新乡投资 PPN003	债券	1,361,720.30	0.64%

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）
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	97,040.11

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

由于产品为封闭式产品，在下一开放日之前，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

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

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	10257000000877613

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。