

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 59 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 59 号
理财产品代码	22131059
A 份额销售代码	22131059A
B 份额销售代码	22131059B
C 份额销售代码	22131059C
D 份额销售代码	22131059D
E 份额销售代码	22131059E
F 份额销售代码	22131059F
产品登记编码	Z7003922000053
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	150.40%
产品起始日期	2022-06-01
产品终止日期	2023-07-04

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	0.9955	174,275,926.00	0.9955	173,486,039.79	-1.68%
2022-09-30	1.0125	174,275,926.00	1.0125	176,459,318.09	

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	0.9955	136,145,521.00	0.9955	135,528,456.59	-1.68%
2022-09-30	1.0125	136,145,521.00	1.0125	137,851,201.49	

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	0.9946	131,172,192.00	0.9946	130,463,416.02	-1.72%
2022-09-30	1.0120	131,172,192.00	1.0120	132,749,544.24	

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	0.9940	248,509,221.00	0.9940	247,022,226.88	-1.75%
2022-09-30	1.0117	248,509,221.00	1.0117	251,414,205.31	

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	0.9955	52,857,530.00	0.9955	52,617,959.18	-1.68%
2022-09-30	1.0125	52,857,530.00	1.0125	53,519,748.36	

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	0.9952	1,760,000.00	0.9952	1,751,511.71	-1.70%
2022-09-30	1.0124	1,760,000.00	1.0124	1,781,754.45	

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	0.48%	0.79%
2	同业存单	0.00%	1.30%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.71%
4	债券	0.00%	93.40%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	3.70%
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%	0.11%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.52%	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	平银优 01	权益类投资	41,186,061.47	3.70%
2	19 徽商银行永续债	债券	19,822,432.65	1.78%
3	22 建发集 MTN002	债券	19,448,941.56	1.75%
4	20 恒丰银行永续债	债券	17,228,442.00	1.55%
5	22 青岛银行永续债 02	债券	16,907,317.27	1.52%
6	22 晋能装备 MTN006	债券	14,141,460.59	1.27%
7	21 北京银行永续债 01	债券	13,312,567.62	1.19%
8	22 建发集 MTN003	债券	13,197,117.80	1.18%
9	22 济南轨交 MTN001	债券	12,157,566.48	1.09%
10	22 绍滨集团 PPN001	债券	9,151,170.27	0.82%

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	535,819.49

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

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	10257000000888003

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。