

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 34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 34 号
理财产品代码	21131034
A 份额销售代码	21131034A
B 份额销售代码	21131034B
产品登记编码	Z7003921000742
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	115.39%
产品起始日期	2022-01-25
产品终止日期	2023-02-08

## 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	1.0149	2,035,962,850.00	1.0149	2,066,346,721.01	0.59%
2022-09-30	1.0089	2,035,962,850.00	1.0089	2,054,045,315.93	

### 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	1.0126	53,780,000.00	1.0126	54,455,894.57	0.54%
2022-09-30	1.0072	53,780,000.00	1.0072	54,165,825.98	

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	0.04%	5.34%
2	同业存单	0.00%	0.48%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.31%
4	债券	0.00%	58.99%
5	非标准化债权类资产	32.58%	28.27%
6	权益类投资	0.00%	5.38%
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%	1.24%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	67.38%	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	连云港城建控股集团有限公司 2022 年第二期	非标准化债权类 资产	491,379,301.00	20.08%
2	株洲新芦淞航空城产业发展有限公 司	非标准化债权类 资产	200,383,266.78	8.19%
3	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	130,620,477.48	5.34%
4	21 三阳 01	债券	22,015,801.05	0.90%
5	22 郎川债	债券	19,107,430.71	0.78%
6	22 东津 02	债券	18,711,630.59	0.76%
7	20 晋电 01	债券	18,404,711.06	0.75%
8	20 海尖 01	债券	18,120,744.67	0.74%
9	20 晋资 02	债券	17,973,464.95	0.73%
10	21 天门债	债券	15,673,025.60	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
1	连云港城建控股集团有限公司	连云港城建控股集团有限公司 2022 年第二期	债权融资计划	5.50	37	正常
2	株洲新芦淞航空产业发展有限公司	株洲新芦淞航空城产业发展有限公司	信托贷款	6.57	34	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	630,923.90

#### 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）
中诚信托有 限责任公司	ZC19KY OTC	中诚信托汇鑫 11 号 集合资金信托计划	买入	20,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC1A34 OTC	中诚信托汇鑫 15 号 集合资金信托计划	买入	20,000,000.00

## 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

本产品对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类、权益类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前组合流动性风险可控。

### 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

本产品持有债券资产信用展望稳定,四季度债券收益率有所上行,整体波动率在合理区间范围内。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的股票仓位相对保守,价格波动对组合净值波动率的影响保持在可控范围内。

#### 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	10257000000878425

## 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。