

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 35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 35 号
理财产品代码	21131035
产品登记编码	Z7003921000743
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	129.63%
产品起始日期	2022-04-08
产品终止日期	2025-04-07

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	1.0109	86,366,274.00	1.0109	87,307,584.09	-0.95%
2022-09-30	1.0206	86,366,274.00	1.0206	88,146,420.22	

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	1.21%	1.48%
2	同业存单	0.00%	1.21%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	71.32%
5	非标准化债权类资产	28.60%	22.10%
6	权益类投资	0.00%	1.29%
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%	2.60%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	70.19%	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	华鑫信托·肇庆新区投资发展有限公司理财融资项目(鑫深 76 号)	非标准化债权类 资产	25,017,652.73	22.10%
2	易方达创业板 ETF 联接 C	公募基金	2,175,913.45	1.92%
3	21 华发 01	债券	1,681,073.04	1.49%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,671,693.49	1.48%
5	平银优 01	权益类投资	1,458,324.44	1.29%
6	22 宁波银行二级资本债 01	债券	1,430,215.63	1.26%
7	21 农发 02	债券	1,202,022.77	1.06%
8	20 淮发 02	债券	1,190,106.73	1.05%
9	22 河钢集 MTN001	债券	1,183,994.28	1.05%
10	20 京科技园 PPN001	债券	1,129,601.85	1.00%

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	肇庆新区投资发展有限公司	华鑫信托·肇庆新区投资发展有限公司理财融资项目(鑫深76号)	信托贷款	5.51	597	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	72,253.62

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	ZC19RE OTC	中诚信托嘉信 12 号 集合资金信托计划	买入	6,000,000.00

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	10257000000878436

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。