

华夏理财固定收益纯债型一年定开理财产品 1 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一年定开理财产品 1 号
理财产品代码	211908700301
A 份额销售代码	211908700301A
B 份额销售代码	211908700301B
产品登记编码	Z7003921000074
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式
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	148.57%
产品起始日期	2021-11-10
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

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	1.0123	174,017,007.41	1.0303	176,164,303.56	-1.15%
2022-09-30	1.0243	205,051,693.03	1.0423	210,040,404.15	

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	1.0134	287,641,949.74	1.0314	291,508,248.28	-1.13%
2022-09-30	1.0252	404,145,729.00	1.0432	414,349,772.98	

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	0.80%	0.73%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.13%
4	债券	0.00%	99.15%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.20%	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	19 民生银行二级 01	债券	9,223,749.91	1.33%
2	20 天成租赁 GN003	债券	8,082,343.94	1.16%
3	20 民生银行二级	债券	7,851,277.83	1.13%
4	20 药租 01	债券	6,885,178.69	0.99%
5	21 首置 03	债券	6,740,574.74	0.97%
6	华恒 01 优	债券	6,581,904.74	0.95%
7	21 孝感 01	债券	6,549,696.95	0.94%
8	21 楚兴 ABN001 优先	债券	5,857,558.69	0.84%
9	20 金泰精诚 ABN001 优先	债券	5,729,462.66	0.82%
10	20 镇交 02	债券	5,560,083.21	0.80%

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	533,535.16
华夏银行股份有限公司	2220071.IB	22 苏州银行小微债	1,565,665.19

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）
英大保险资产管理有限 公司	YD-HLYJ OTC	英大资产活利壹玖 资产管理产品	买入	100,000,000.00
英大基金管 理有限公司	650956 OTC	英大基金-华英稳健 5号集合资产管理计 划	买入	466,000,000.00

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,合理配置货币类、债券类资产,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

无。

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	10257000000857029

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。