

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 23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 23 号
理财产品代码	21131023
A 份额销售代码	21131023A
B 份额销售代码	21131023B
产品登记编码	Z7003921000736
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	132.53%
产品起始日期	2022-02-09
产品终止日期	2023-02-07

## 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	1.0006	3,985,734,896.00	1.0006	3,988,048,797.37	-0.61%
2022-09-30	1.0067	3,985,744,896.00	1.0067	4,012,645,827.33	

### 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	0.9984	217,933,541.00	0.9984	217,575,193.08	-0.67%
2022-09-30	1.0051	217,933,541.00	1.0051	219,054,579.22	

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	2.76%	3.33%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.79%
4	债券	0.00%	86.17%
5	非标准化债权类资产	2.24%	1.69%
6	权益类投资	0.00%	3.54%
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	3.69%	3.48%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	91.31%	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 民生银行永续债	债券	216,217,918.64	3.88%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	185,811,411.65	3.33%
3	19 广发银行永续债	债券	125,305,676.51	2.25%
4	平银优 01	权益类投资	125,010,170.39	2.24%
5	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	99,563,730.71	1.79%
6	收益凭证.中金公司金泽 PB0146.中 证指数	非标准化债权类 资产	94,208,947.00	1.69%
7	22 首股 02	债券	72,511,138.98	1.30%
8	交行优 1	权益类投资	72,289,424.25	1.30%
9	19 平安银行二级	债券	68,380,921.95	1.23%
10	22 盐城资产 PPN001	债券	51,069,288.90	0.92%

### 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	中国国际金融股份有限公司	收益凭证.中金公司金泽PB0146.中证指数	收益凭证	无固定收益率	31	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	1,693,016.44
华夏银行股份有限公司	2220071.IB	22 苏州银行小微债	12,711,016.89

#### 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	40,000,000.00

## 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

报告期内无流动性风险事件发生。

### 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

本产品主要配置货币市场工具、利率债、同业存单和国企、央企城投债，信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生，价格波动可控。

#### 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

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	10257000000878130

## 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。