

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 40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 40 号 |
| 理财产品代码  | 21131040                |
| 产品登记编码  | Z7003922000006          |
| 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    | 125.81%                 |
| 产品起始日期  | 2022-06-16              |
| 产品终止日期  | 2024-06-25              |

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数(份)        | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)        | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-12-31 | 1.0099      | 261,224,028.00 | 1.0099      | 263,822,155.89 | -0.32%        |
| 2022-09-30 | 1.0131      | 261,224,028.00 | 1.0131      | 264,646,215.05 |               |

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       | 1.95%     | 1.91%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 3.51%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.14%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 55.97%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 44.30%    | 35.28%    |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 3.20%     |
| 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        | 53.76%    | 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|-----------------------------------|---------------|---------------|-------------|
| 1  | 中国平煤神马能源化工集团有限公司 2022 年第二期债权融资计划  | 非标准化债权类<br>资产 | 90,082,615.80 | 27.14%      |
| 2  | 温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年度第六期债权融资计划 | 非标准化债权类<br>资产 | 14,999,227.67 | 4.52%       |
| 3  | 济南章丘控股集团有限公司理财投融资项目二期(渤海金雀 97)    | 非标准化债权类<br>资产 | 12,014,135.84 | 3.62%       |
| 4  | 21 天成租赁 GN001                     | 债券            | 6,970,027.89  | 2.10%       |
| 5  | 光大优 3                             | 权益类投资         | 6,689,103.14  | 2.02%       |
| 6  | 存款及清算款等现金类资产                      | 现金及银行存款       | 6,337,382.40  | 1.91%       |
| 7  | 22 首股 04                          | 债券            | 4,272,699.16  | 1.29%       |
| 8  | 22 津辰 03                          | 债券            | 4,255,987.97  | 1.28%       |
| 9  | 20 江苏银行永续债                        | 债券            | 3,797,889.77  | 1.14%       |
| 10 | 21 徐州新盛 MTN002                    | 债券            | 3,109,943.74  | 0.94%       |

### 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  | 中国平煤神马能源化工集团有限公司 | 中国平煤神马能源化工集团有限公司 2022 年第二期债权融资计划  | 债权融资计划 | 5.70   | 170     | 正常   |
| 2  | 温州市鹿城区国有控股集团有限公司 | 温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年度第六期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.13   | 180     | 正常   |
| 3  | 济南章丘控股集团有限公司     | 济南章丘控股集团有限公司理财投融资项目二期(渤海金雀 97)    | 信托贷款   | 6.20   | 339     | 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 | 102282373.IB | 22 鹤壁投资 MTN003 | 150,961.67 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102282474.IB | 22 株国投 MTN002  | 430,287.77 |

#### 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

本产品持有债券整体风险可控,成立以来债券收益率震荡上行,但整体波动率仍处在合理区间范围内。

#### 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 | 10257000000882817 |

## 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。