

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 43 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 43 号
理财产品代码	22131043
A 份额销售代码	22131043A
B 份额销售代码	22131043B
C 份额销售代码	22131043C
D 份额销售代码	22131043D
产品登记编码	Z7003922000031
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	132.40%
产品起始日期	2022-03-15
产品终止日期	2023-04-11

## 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	1.0237	1,482,589,944.00	1.0237	1,517,771,596.90	-0.19%
2022-09-30	1.0257	1,482,589,944.00	1.0257	1,520,742,922.29	

### 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	1.0233	29,043,145.00	1.0233	29,720,485.82	-0.21%
2022-09-30	1.0255	29,043,145.00	1.0255	29,782,422.55	

### C 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	1.0217	121,683,408.00	1.0217	124,322,916.02	-0.25%
2022-09-30	1.0243	121,683,408.00	1.0243	124,644,822.23	

### D 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	1.0225	112,440,000.00	1.0225	114,970,621.81	-0.23%
2022-09-30	1.0249	112,440,000.00	1.0249	115,239,261.31	

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	0.35%	0.53%
2	同业存单	0.00%	3.86%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.14%
4	债券	0.00%	63.39%
5	非标准化债权类资产	38.22%	28.92%
6	权益类投资	0.00%	2.83%
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%	0.34%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	61.43%	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	山东信托圆泰 288 号集合资金信托计划	非标准化债权类资产	400,659,055.42	16.94%
2	北京市通州区国有资本运营有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	283,489,939.15	11.98%
3	21 航租 Y1	债券	21,647,651.63	0.92%
4	光大优 3	权益类投资	17,771,240.55	0.75%
5	上银优 1	权益类投资	17,261,752.26	0.73%
6	21 徐州新盛 MTN002	债券	14,716,825.43	0.62%
7	21 江北建投 MTN001	债券	14,704,172.14	0.62%
8	杭银优 1	权益类投资	13,803,861.28	0.58%
9	22 住总 Y1	债券	13,613,815.62	0.58%
10	22 首股 04	债券	13,600,166.40	0.57%

### 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	吉安市城市建设投资开发有限公司	山东信托圆泰288号集合资金信托计划	信托贷款	5.58	80	正常
2	北京市通州区国有资本运营有限公司	北京市通州区国有资本运营有限公司2022年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.40	97	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	111,905.63
华夏银行股份有限公司	102282472.IB	22 胶州湾 MTN002	1,542,256.21
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	1,101,121.49

#### 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	10257000000882862

## 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。