

华夏理财固定收益增强周期 60 天理财产品 A 款

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周期 60 天理财产品 A 款
理财产品代码	211918701101
产品登记编码	Z7003921000270
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	124.90%
产品起始日期	2021-04-20
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

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	1.0586	7,046,727,325.63	1.0586	7,459,964,259.26	-0.82%
2022-09-30	1.0673	19,080,514,526.39	1.0673	20,364,803,373.01	

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	0.16%	7.33%
2	同业存单	0.00%	1.56%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	10.87%
4	债券	1.19%	78.34%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	1.13%
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	0.34%	0.78%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.31%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	1,012,948,409.00	10.87%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	681,893,448.78	7.32%
3	20 汇鑫 ABN002 优先	债券	161,797,422.47	1.74%
4	21 光穗铜冠 ABN001 优先	债券	161,216,503.96	1.73%
5	20 黄石交投 PPN001	债券	120,325,252.84	1.29%
6	20 平金 02	债券	113,297,214.71	1.22%
7	20 平发 02	债券	112,034,375.25	1.20%
8	20 陕建控股 PPN001	债券	108,387,391.31	1.16%
9	20 中交投资 ABN001 优先	债券	107,072,148.38	1.15%
10	至诚 14A	债券	105,584,707.44	1.13%

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	102282373.IB	22 鹤壁投资 MTN003	5,759,658.48
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	6,721,066.11

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	590,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	150,000,000.00

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

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整。此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出、基金赎回等方式优化组合的流动性管理。

5.2 投资组合投资风险分析

回顾四季度，10月坚持“动态清零”和降准置换MLF预期下，收益率有所下行，但11月随着地产政策和防控政策的边际放松，市场对经济修复预期加强叠加理财赎回负反馈，债券大幅调整，一直到12月中旬债市企稳反弹。展望2023年，经济复苏政策持续发力，内需改善与基建制造投资托底，助力经济增长，若经济复苏超预期利率中枢可能会有上行压力。操作上，鉴于产品特性，维持久期杠杆较低水平，增加低波资产配置。

5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，产品持仓的债券价格波动处于市场合理区间范围。

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	10257000000863532

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。