

华夏理财固定收益增强型 14 天定开理财产品 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	华夏理财固定收益增强型 14 天定开理财产品 1 号
理财产品代码	2119187301
A 份额销售代码	2119187301A
B 份额销售代码	2119187301B
C 份额销售代码	2119187301C
产品登记编码	Z7003921000290
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	137.78%
产品起始日期	2021-06-25
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	1.0467	182,867,934.48	1.0467	191,415,045.47	-0.98%
2022-09-30	1.0571	324,358,793.10	1.0571	342,894,732.13	

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	1.0192	177,694,556.75	1.0192	181,105,343.11	-1.02%
2022-09-30	1.0297	700,899,403.39	1.0297	721,725,978.27	

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	1.0130	18,227,519.03	1.0130	18,464,202.65	-0.96%
2022-09-30	1.0228	58,050,627.17	1.0228	59,373,268.45	

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	0.61%	0.93%
2	同业存单	0.00%	5.11%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.73%
4	债券	0.00%	92.17%
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	0.08%	0.06%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.30%	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	22 国开 06	债券	50,525,994.97	9.38%
2	20 国兴 01	债券	12,782,688.63	2.37%
3	16 武国资	债券	12,198,171.95	2.26%
4	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	9,303,584.36	1.73%
5	20 连城 01	债券	8,698,804.42	1.61%
6	22 汉口银行 CD068	同业存单	8,365,956.04	1.55%
7	22 盐城资产 PPN001	债券	8,256,721.09	1.53%
8	G20 长交 1	债券	7,882,144.53	1.46%
9	22 红狮 SCP004	债券	7,696,222.94	1.43%
10	19 金水 02	债券	7,355,001.83	1.37%

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	102282472.IB	22 胶州湾 MTN002	155,339.08
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	1,722,845.46

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

本产品为高频开放产品，产品配置一定比例高流动、可快速变现资产，应对可能出现的申赎。报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控。

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。产品组合久期控制在 1 以内，价格波动水平整体可控。

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	10257000000867004

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。