

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 16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 16 号
理财产品代码	21131016
A 份额销售代码	21131016A
B 份额销售代码	21131016B
产品登记编码	Z7003921000400
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	125.10%
产品起始日期	2021-11-02
产品终止日期	2023-05-16

## 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	1.0339	540,894,416.00	1.0339	559,218,521.52	-0.11%
2022-09-30	1.0350	540,894,416.00	1.0350	559,809,616.58	

### 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	1.0345	125,042,481.00	1.0345	129,353,625.33	-0.09%
2022-09-30	1.0354	125,042,481.00	1.0354	129,474,033.86	

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	0.00%	3.17%
2	同业存单	0.00%	2.03%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.74%
4	债券	0.00%	53.05%
5	非标准化债权类资产	46.45%	37.20%
6	权益类投资	0.00%	1.80%
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	53.54%	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	湖州吴兴城市投资发展集团有限公司 2021 年度第四期债权融资计划	非标准化债权类 资产	320,456,080.94	37.20%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	27,345,919.15	3.17%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	23,594,459.23	2.74%
4	21 合建投 MTN002	债券	21,846,785.23	2.54%
5	21 国新 03	债券	18,209,084.60	2.11%
6	20 济城 G1	债券	15,271,271.72	1.77%
7	20 民生银行二级	债券	11,012,568.11	1.28%
8	21 鄂交 01	债券	8,364,082.83	0.97%
9	21 穗发 02	债券	7,611,215.11	0.88%
10	21 广越 07	债券	6,546,953.26	0.76%

### 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	湖州吴兴城市投资发展集团有限公司	湖州吴兴城市投资发展集团有限公司 2021 年度第四期债权融资计划	债权融资计划	6.50	135	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	192,434.04

#### 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）
英大基金管理 有限公司	650952 OTC	英大基金-华英稳健 3号集合资产管理计 划	买入	4,500,000.00
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	32,600,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19KZ OTC	中诚信托嘉信配置 1 号集合资金信托计 划	买入	10,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19RI OTC	中诚信托汇鑫 12 号 集合资金信托计划	买入	6,800,000.00

## 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

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

本产品持有债券资产信用展望稳定,成立以来债券收益率震荡向下,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

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	10257000000873120

## 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。