

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 57 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 57 号
理财产品代码	22131057
A 份额销售代码	22131057A
B 份额销售代码	22131057B
C 份额销售代码	22131057C
D 份额销售代码	22131057D
E 份额销售代码	22131057E
F 份额销售代码	22131057F
产品登记编码	Z7003922000051
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	142.65%
产品起始日期	2022-06-08
产品终止日期	2023-07-04

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	0.9992	139,435,038.00	0.9992	139,317,211.59	-1.26%
2022-09-30	1.0120	139,435,038.00	1.0120	141,106,267.63	

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	0.9992	139,635,837.00	0.9992	139,517,840.83	-1.26%
2022-09-30	1.0120	139,635,837.00	1.0120	141,309,473.22	

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	0.9983	42,324,870.00	0.9983	42,253,318.29	-1.30%
2022-09-30	1.0115	42,324,870.00	1.0115	42,812,104.34	

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	0.9977	401,389,391.00	0.9977	400,484,735.24	-1.34%
2022-09-30	1.0112	401,389,391.00	1.0112	405,883,318.15	

E 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	0.9992	570,910,160.00	0.9992	570,427,725.23	-1.26%
2022-09-30	1.0120	570,910,160.00	1.0120	577,752,930.31	

F 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	0.9989	350,000.00	0.9989	349,605.71	-1.27%
2022-09-30	1.0118	350,000.00	1.0118	354,139.65	

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	0.28%	0.40%
2	同业存单	0.00%	1.04%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.16%
4	债券	0.00%	81.44%
5	非标准化债权类资产	18.57%	13.03%
6	权益类投资	0.00%	3.69%
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%	0.24%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	81.16%	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	厦门信托.盐城市交通投资建设控股集团 集团有限责任公司理财融资项目 703 到期	非标准化债权类 资产	240,243,988.57	13.03%
2	平银优 01	权益类投资	68,107,653.00	3.69%
3	19 徽商银行永续债	债券	32,779,520.94	1.78%
4	22 建发集 MTN002	债券	32,161,894.48	1.74%
5	20 恒丰银行永续债	债券	28,489,948.00	1.55%
6	22 青岛银行永续债 02	债券	27,958,917.58	1.52%
7	22 晋能装备 MTN006	债券	23,385,137.02	1.27%
8	21 北京银行永续债 01	债券	22,014,431.67	1.19%
9	22 建发集 MTN003	债券	21,823,517.17	1.18%
10	22 济南轨交 MTN001	债券	21,809,844.31	1.18%

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	盐城市交通投资建设控股集团有限公司	厦门信托.盐城市交通投资建设控股集团有限公司理财融资项目 703 到期	信托贷款	4.91	184	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	770,534.98

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	ydhywj02 OTC	英大基金-华英稳健 2号集合资产管理计 划	买入	40,000,000.00

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，做好流动性管理。

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

截止本报告日，本产品投资的债券价格波动处于市场合理区间范围内。

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

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000888296

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。