

华夏理财固定收益增强最短持有 180 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最短持有 180 天理财产品 A 款
理财产品代码	22135003
A 份额销售代码	22135003A
C 份额销售代码	22135003C
H 份额销售代码	22135003H
V 份额销售代码	22135003V
Y 份额销售代码	22135003Y
Z 份额销售代码	22135003Z
产品登记编码	Z7003922000015
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	135.22%
产品起始日期	2022-03-22
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	1.0124	11,879,419,440.03	1.0124	12,026,873,998.06	-1.16%
2022-09-30	1.0243	9,078,931,067.90	1.0243	9,299,353,292.68	

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	0.9929	18,188,227.14	0.9929	18,058,606.92	-1.15%
2022-09-30	1.0045	13,659,149.93	1.0045	13,720,708.37	

H 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	0.9902	1,127,855,203.74	0.9902	1,116,753,332.64	-1.13%
2022-09-30	1.0015	971,082,069.70	1.0015	972,546,594.09	

V 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	0.9898	2,422,104,272.54	0.9898	2,397,448,018.87	-1.16%
2022-09-30	1.0014	2,372,308,435.47	1.0014	2,375,683,475.55	

Y 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	0.9907	30,197,677.76	0.9907	29,917,992.35	-1.11%
2022-09-30	1.0018	29,943,387.32	1.0018	29,998,635.37	

Z 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	0.9921	11,542.43	0.9921	11,450.79	-1.14%
2022-09-30	1.0035	51.00	1.0035	51.18	

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	0.09%	4.41%
2	同业存单	0.00%	0.98%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.70%
4	债券	0.00%	92.46%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	1.00%
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	0.00%	0.46%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.91%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	928,910,558.08	4.41%
2	20 恒丰银行永续债	债券	285,599,593.81	1.35%
3	22 济南轨交 MTN001	债券	218,366,717.69	1.04%
4	平银优 01	权益类投资	210,552,621.53	1.00%
5	21 徐州高新 PPN001	债券	209,539,651.21	0.99%
6	20 德建 01	债券	166,072,739.37	0.79%
7	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	147,570,835.58	0.70%
8	20 富阳 01	债券	118,985,143.67	0.56%
9	22 建发集 MTN003	债券	117,901,622.94	0.56%
10	20 北坤投资 PPN001	债券	116,542,648.23	0.55%

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	102282474.IB	22 株国投 MTN002	8,417,248.31

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	ydhywj01 OTC	英大基金-华英稳健 1号集合资产管理计 划	买入	80,000,000.00
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	380,000,000.00

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。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，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，本产品投资的债券资产市场价格波动处于合理区间范围内。

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	10257000000881336

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。