

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 38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 38 号
理财产品代码	21131038
A 份额销售代码	21131038A
B 份额销售代码	21131038B
C 份额销售代码	21131038C
D 份额销售代码	21131038D
E 份额销售代码	21131038E
F 份额销售代码	21131038F
产品登记编码	Z7003922000004
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	131.89%
产品起始日期	2022-05-18
产品终止日期	2023-06-13

## 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	1.0090	263,647,574.00	1.0090	266,023,941.39	-0.59%
2022-09-30	1.0150	263,647,574.00	1.0150	267,609,395.20	

### 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	1.0090	334,845,248.00	1.0090	337,863,350.25	-0.59%
2022-09-30	1.0150	334,845,248.00	1.0150	339,876,953.74	

### 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	1.0081	150,228,237.00	1.0081	151,440,971.53	-0.63%
2022-09-30	1.0145	150,228,237.00	1.0145	152,401,144.95	

### 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	1.0074	590,541,916.00	1.0074	594,939,040.54	-0.66%
2022-09-30	1.0141	590,581,916.00	1.0141	598,902,589.53	

### 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	1.0090	353,553,803.00	1.0090	356,740,533.57	-0.59%
2022-09-30	1.0150	353,553,803.00	1.0150	358,866,641.50	

## 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	1.0087	5,624,538.00	1.0087	5,673,469.78	-0.60%
2022-09-30	1.0148	5,624,538.00	1.0148	5,708,002.05	

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	0.50%	1.13%
2	同业存单	0.00%	1.04%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.57%
4	债券	0.00%	75.13%
5	非标准化债权类资产	26.33%	19.99%
6	权益类投资	0.00%	1.14%
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%	1.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	73.17%	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	洛阳国晟.山东信托.530	非标准化债权类 资产	270,392,672.55	11.97%
2	昆仑信托.天津市政投资有限公司理 财融资项目 333 天	非标准化债权类 资产	100,136,622.63	4.43%
3	渤海信托.2022 金雀 90 号.常德城市 发展项目	非标准化债权类 资产	81,095,567.69	3.59%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	25,543,640.00	1.13%
5	19 民生银行永续债	债券	24,291,608.76	1.08%
6	民生优 1	权益类投资	21,425,866.37	0.95%
7	19 农业银行永续债 01	债券	16,003,021.16	0.71%
8	19 广发银行永续债	债券	15,944,372.35	0.71%
9	20 赣版 01	债券	13,760,896.39	0.61%
10	19 北汽 06	债券	13,697,530.99	0.61%

### 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	洛阳国晟投资控股集团有限公司	洛阳国晟.山东信托.530	信托贷款	5.00	150	正常
2	天津市政投资有限公司	昆仑信托.天津市政投资有限公司理财融资项目 333 天	信托贷款	4.97	149	正常
3	常德市城市发展集团有限公司	渤海信托.2022金雀 90 号.常德城市发展项目	信托贷款	5.11	145	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	374,569.90

#### 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	30,000,000.00

#### 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

由于产品为封闭式产品，在下一开放日之前，客户无提前终止权，不可赎回本期产品，故投资组合流动性风险较低。

### 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

截至本报告日，产品投资的债券资产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

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	10257000000882806

## 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。