

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 70 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 70 号
理财产品代码	22131070
A 份额销售代码	22131070A
B 份额销售代码	22131070B
C 份额销售代码	22131070C
D 份额销售代码	22131070D
产品登记编码	Z7003922000088
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	123.99%
产品起始日期	2022-08-17
产品终止日期	2023-09-12

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	0.9838	119,692,602.00	0.9838	117,748,426.34	-1.35%
2022-09-30	0.9973	119,692,602.00	0.9973	119,364,940.65	

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	0.9838	211,939,246.00	0.9838	208,496,701.44	-1.35%
2022-09-30	0.9973	211,939,246.00	0.9973	211,359,057.33	

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	0.9834	98,491,519.00	0.9834	96,855,614.66	-1.37%
2022-09-30	0.9971	98,491,519.00	0.9971	98,210,055.73	

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	0.9830	387,178,109.00	0.9830	380,605,377.45	-1.40%
2022-09-30	0.9970	387,178,109.00	0.9970	386,025,113.35	

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	0.76%	1.27%
2	同业存单	0.00%	2.04%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	4.66%
4	债券	0.00%	85.81%
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	0.00%	6.22%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.24%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	46,408,540.86	4.66%
2	19 平安银行二级	债券	26,758,264.53	2.69%
3	16 黔高速	债券	25,862,303.57	2.60%
4	19 交通银行二级 01	债券	23,040,626.38	2.31%
5	21 拱墅 03	债券	21,523,506.69	2.16%
6	21 郑州经开 MTN001	债券	19,474,709.50	1.95%
7	21 凤凰 01	债券	16,518,637.58	1.66%
8	21 凤凰 02	债券	16,442,961.30	1.65%
9	21 北部湾 MTN002	债券	16,380,951.44	1.64%
10	21 广物 01	债券	15,900,795.79	1.60%

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）
-	-	-	-

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

本产品报告期内未开放，且持有 5%以上的高流动性资产，能够满足临时赎回的需要，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

本产品持有超 80%比例的债券资产，久期在 1-2 年，信用等级较高，采用市值法估值，具有一定的价格波动风险。四季度债券市场剧烈调整，拖累产品净值表现。债券回调源于纾解房地产信用风险的各项政策陆续出台，对“新冠”疫情的防控也有所放松，过去三年拖累经济景气度的两大因素均有实质性好转。同时，经过近两年的债券牛市，市场收益率已处于历史绝对低位，各期限品种信用利差也大幅压缩。而自 10 月份开始资金市场中枢缓慢抬升，使得债券市场“杠杆-套息”的盈利模式逐渐被打破。此外，债券收益率快速回升，叠加各类资管机构赎回潮，造成了本次债券市场调整。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品未直接持有股票，持有 4%左右风格均衡的公募基金参与权益市场投资。四季度权益市场迎来较大幅度的上涨，对组合收益有正向贡献。一方面，市场经历前期较大幅度下跌，估值处于较低水平；另一方面，防疫、地产等政策的显著转向，叠加年底重要会议定调，提振了市场信心。

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	10250000003302059

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。