

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 18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	华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 18 号
理财产品代码	22721018
产品登记编码	Z7003922A000009
产品募集方式	私募
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	101.40%
产品起始日期	2022-08-12
产品终止日期	2024-02-21

第二章 净值、存续规模及收益表现

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	1.0088	400,000,000.00	1.0088	403,513,043.01	0.72%
2022-09-30	1.0016	400,000,000.00	1.0016	400,647,022.60	

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	1.30%	1.48%
2	同业存单	0.00%	0.59%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.24%
4	债券	0.00%	15.07%
5	非标准化债权类资产	82.25%	81.18%
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%	1.44%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	16.45%	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	北京市通州区国有资本运营有限公司 2022 年度第二期债权融资计划	非标准化债权类 资产	140,630,231.80	34.37%
2	科学城(广州)投资集团有限公司 2022 年度第四期债权融资计划	非标准化债权类 资产	120,459,776.85	29.44%
3	百瑞信托.沛县城市建设投资发展集团有限公司理财融资项目(百瑞富诚 847 号)	非标准化债权类 资产	58,054,658.71	14.19%
4	渤海信托.2022 金雀 106 号.常德市海 绵城市建设投资开发有限公司理财 融资项目	非标准化债权类 资产	13,012,967.89	3.18%
5	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	6,066,886.62	1.48%
6	21 拱墅 03	债券	3,322,383.82	0.81%
7	21 德邦 C1	债券	1,688,917.19	0.41%
8	22 联优 02	债券	1,616,724.55	0.40%
9	21 平证 Y1	债券	1,609,551.42	0.39%
10	易方达恒久 1 年定期债券 A	公募基金	1,603,135.22	0.39%

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	北京市通州区国有资本运营有限公司	北京市通州区国有资本运营有限公司 2022 年度第二期债权融资计划	债权融资计划	5.20	238	正常
2	科学城(广州)投资集团有限公司	科学城(广州)投资集团有限公司 2022 年度第四期债权融资计划	债权融资计划	5.10	243	正常
3	沛县城市建设投资发展集团有限公司	百瑞信托.沛县城市建设投资发展集团有限公司理财融资项目(百瑞富诚 847 号)	信托贷款	4.91	265	正常
4	常德市海绵城市建设投资开发有限公司	渤海信托.2022 金雀 106 号.常德市海绵城市建设投资开发有限公司理财融资项目	信托贷款	5.30	237	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）
-	-	-	-

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

本产品为封闭式产品，在报告期内未开放，持有 600 万左右现金及存款和 16%左右的开放式资产，能够满足临时赎回的要求。

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 13%左右的纯债和 2%左右的转债。四季度受到稳增长政策出台的触发和银行理财赎回的影响，债券估值波动较大；转债市场震荡下跌；两部分都为净值带来了一定的拖累。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有 1%左右的混合类公募基金。四季度权益市场下跌 2 个月后开始反弹，整体看公募基金净值下跌。

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	10257000000888977

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。