

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 21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 21 号
理财产品代码	22721021
产品登记编码	Z7003922A000007
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	107.71%
产品起始日期	2022-05-26
产品终止日期	2023-05-17

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	1.0046	400,000,000.00	1.0046	401,856,259.10	-0.79%
2022-09-30	1.0126	400,000,000.00	1.0126	405,047,149.58	

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	0.06%	5.19%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.57%
4	债券	0.00%	93.34%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.84%
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%	0.06%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.94%	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	22 中远 3A	债券	40,149,938.71	9.28%
2	16 陕西旅游债	债券	34,263,010.06	7.92%
3	20 首致 01	债券	32,025,952.92	7.40%
4	19 宝鸡投资 PPN002	债券	27,532,186.96	6.36%
5	22 濮阳 01	债券	26,724,403.72	6.17%
6	20 淮投 01	债券	25,238,820.92	5.83%
7	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	22,467,819.89	5.19%
8	22 南谯国资 PPN001	债券	17,088,192.85	3.95%
9	20 光大嘉宝 MTN002	债券	15,620,637.33	3.61%
10	21 六新 01	债券	14,256,196.73	3.29%

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	162,604.42

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

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	10257000000889131

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。