

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% | 13.99% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 82.25% | 81.18% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 1.08% |
| 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 | 权益类投资 | 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 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品持有的权益仓位价格波动对组合净值波动的影响保持在可控范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

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。