

# 华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 18号

## 2022年年度报告

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08月12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	0.88%
2022-08-12	1.0000	-	1.0000	-	

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）
华夏银行股份有限公司	042280372.IB	22 武清国资 CP004	428,810.61
华夏银行股份有限公司	fb20220826A	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	140,000,000.00
华夏银行股份有限公司	fb20220831A	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	120,000,000.00

#### 3.4.3 报告期内其他重大关联交易

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

产品为封闭式，在报告期内未开放，截至本报告日，产品持有 1.6%左右的现金及买入返售资产，可以应对一定程度的临时赎回，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，产品持有 81%左右的非标和 13%左右的纯债资产，资质较优，市值波动可控。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，产品持有少量的永续债、优先股和权益类公募基金，市值随着市场情况波动，对产品净值会有一些影响。

#### 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。

## 第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品  
在投资运作过程中存在违反法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。