

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 18号

2023年第2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：2023年4月1日至2023年6月30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	103.06%
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
2023-06-30	1.0327	400,000,000.00	1.0327	413,084,512.69	0.98%
2023-03-31	1.0227	400,000,000.00	1.0227	409,093,082.75	

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	0.94%	1.18%
2	同业存单	0.00%	0.15%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.23%
4	债券	0.00%	17.68%
5	非标准化债权类资产	80.31%	78.06%
6	权益类投资	0.00%	1.25%
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%	1.45%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	18.75%	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；“权益类投资”类别中包含永续债和优先股。

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	140,697,060.41	33.05%
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	120,500,256.62	28.31%
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	58,074,335.80	13.64%
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	13,017,238.10	3.06%
5	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	5,005,779.88	1.18%
6	20 碧地 02	债券	3,218,880.85	0.76%
7	20 天恒置业 PPN006	债券	2,125,471.25	0.50%
8	20 新希望 MTN002	债券	2,058,991.75	0.48%
9	20 武港 01	债券	2,057,236.06	0.48%
10	G20 水利 1	债券	2,056,626.33	0.48%

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	5.2000	57	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	5.1000	62	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	4.9123	84	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	5.3000	56	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	投资规模（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	投资规模（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	投资规模（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，持仓中有一定比例的高流动性资产，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

截至本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优。根据公司理财产品风险分类的要求，持仓中 PR 龙债 02（代码 166599.SH）、PR01 优（代码 169741.SH）、20 远资 01（代码 175093.SH）的资产风险分类为关注类。PR01 优（代码 169741.SH）的原始权益人/差额支付人/售回和回购承诺人其他公开债务存在展期的情形，20 远资 01（代码 175093.SH）债券发行人其他公开债务存在展期的情形。同时，20 远资 01（175093.SH）发行人远洋资本有限公司 2023 年 4 月主体信用评级被中诚信国际信用评级有限责任公司由 AA+调低至 AA，评级展望调整为负面，2023 年 6 月主体信用评级被中诚信国际信用评级有限责任公司 AA 调低至 A+，评级展望维持负面。这几只债券在产品持仓中占比不高 0.4%，对产品净值影响较小。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

产品持有的权益资产大部分为永续债和优先股，少部分为权益 FOF 和 ETF，价格随着市场变化而波动，对产品净值影响可控。

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。