

# 华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 22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 22 号
理财产品代码	22721022
产品登记编码	Z7003922A000008
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	115.51%
产品起始日期	2022-08-05
产品终止日期	2023-07-31

## 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	1.0337	1,000,000,000.00	1.0337	1,033,746,625.92	1.35%
2023-03-31	1.0199	1,000,000,000.00	1.0199	1,019,872,266.87	

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	0.73%	0.73%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	63.74%
5	非标准化债权类资产	19.46%	16.88%
6	权益类投资	0.00%	18.65%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	79.81%	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	乐山国有资产投资运营(集团)有限公司 2022 年度第三期债权融资计划	非标准化债权类 资产	201,609,391.03	16.88%
2	21 京城投 MTN002	债券	103,061,865.39	8.63%
3	22 佛燃能源 MTN002	权益类投资	101,591,950.49	8.51%
4	22 国开 02	债券	100,036,374.19	8.38%
5	20 国开 08	债券	99,933,818.54	8.37%
6	22 济南轨交 MTN001	债券	51,680,314.03	4.33%
7	22 龙岩汇金 MTN002	权益类投资	50,844,076.58	4.26%
8	22 陕投集团 MTN004	权益类投资	50,353,194.01	4.22%
9	22 农发 03	债券	50,029,268.68	4.19%
10	22 湖州城投 MTN004(可持续挂钩)	债券	40,586,387.91	3.40%

### 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	乐山国有资产投资运营(集团)有限公司	乐山国有资产投资运营(集团)有限公司 2022 年度第三期债权融资计划	债权融资计划	5.7000	28	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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，全部为 AA+以上评级债券，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系封闭式产品，根据产品到期日，做好流动性管理。

### 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，价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 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

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

## 第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000889142

## 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。