

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 8 号

2022 年第 3 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 07 月 01 日至 2022 年 09 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 8 号
理财产品代码	21721008
产品登记编码	Z7003921A000011
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	102.00%
产品起始日期	2022-05-06
产品终止日期	2024-05-15

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
2022-09-30	1.0144	100,000,000.00	1.0144	101,441,972.04	1.05%
2022-06-30	1.0039	100,000,000.00	1.0039	100,391,433.11	

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	5.07%	5.06%
2	同业存单	0.00%	0.06%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	15.06%
5	非标准化债权类资产	78.94%	77.49%
6	权益类投资	0.00%	1.23%
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%	1.09%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	15.99%	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	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	50,172,686.05	48.49%
2	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	30,001,674.44	29.00%
3	现金及银行存款	现金及银行存款	5,237,567.09	5.06%
4	平银优 01	权益类投资	1,276,798.04	1.23%
5	19 徽商银行永续债	债券	647,604.41	0.63%
6	20 恒丰银行永续债	债券	567,084.94	0.55%
7	22 建发集 MTN002	债券	550,808.92	0.53%
8	22 青岛银行永续债 02	债券	538,376.43	0.52%
9	20 首致 01	债券	507,853.93	0.49%
10	20 潍投 01	债券	485,811.73	0.47%

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	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	357	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	335	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	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	50,000,000.00

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）
英大基金管理有限公司	ydhywj02 OTC	英大基金-华英稳健 2号集合资产管理计 划	买入	55,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	3,150,000.00

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，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品将根据到期情况，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

截止本报告日，本产品投资的债券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

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	10257000000871860

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。