

# 华夏理财固收债权臻享封闭私募理财产品 4 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    | 华夏理财固收债权臻享封闭私募理财产品 4 号 |
| 理财产品代码  | 22741004               |
| 产品登记编码  | Z7003922A000018        |
| 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    | 101.28%                |
| 产品起始日期  | 2022-06-29             |
| 产品终止日期  | 2023-08-01             |

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数(份)        | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)        | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-12-31 | 1.0205      | 200,000,000.00 | 1.0205      | 204,101,977.26 | 1.03%         |
| 2022-09-30 | 1.0101      | 200,000,000.00 | 1.0101      | 202,023,640.01 |               |

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       | 2.21%     | 2.20%     |
| 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%     | 5.70%     |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 93.07%    | 92.00%    |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 0.00%     |
| 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%     | 0.10%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 4.72%     | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|--|---------------|----------------|-------------|
| 1  | 厦门信托·盐城市交通投资建设控股集团<br>集团有限责任公司理财融资项目<br>731 到期 | 非标准化债权类<br>资产 | 190,179,268.70 | 92.00%      |
| 2  | 存款及清算款等现金类资产                                   | 现金及银行存款       | 4,541,403.18   | 2.20%       |
| 3  | 21 光穗广开 ABN001 优先                              | 债券            | 239,617.26     | 0.12%       |
| 4  | 20 光穗鲲鹏 ABN001 优先                              | 债券            | 207,027.56     | 0.10%       |
| 5  | 20 恒信 G1                                       | 债券            | 200,250.27     | 0.10%       |
| 6  | 20 潞安 PPN004                                   | 债券            | 184,539.95     | 0.09%       |
| 7  | 21 淮交 01                                       | 债券            | 172,598.37     | 0.08%       |
| 8  | 20 晋金 01                                       | 债券            | 166,373.37     | 0.08%       |
| 9  | 22 南翼 01                                       | 债券            | 150,732.33     | 0.07%       |
| 10 | 21 国海 01                                       | 债券            | 150,240.43     | 0.07%       |

### 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  | 盐城市交通投资建设控股集团有限公司 | 厦门信托.盐城市交通投资建设控股集团有限公司理财融资项目 731 到期 | 信托贷款 | 4.91   | 212     | 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

本产品以债券等固收类资产为主要投资标的，追求稳健回报，同时精选权益基金，为组合谋求超额收益。本产品固收部分主要投向资管计划以及债券，同时根据市场行情变化，动态调整相关资产的比例，平衡产品投资收益以及流动性。穿透资管计划，本产品投资的资管计划底层债券资产以 AA 以上评级债券为主，品种上以城投债以及国有企业债券为主。本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，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，产品投资的债券资产信用展望稳定，债券价格波动处于合理的市场波动区间。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，无权益持仓。

#### 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 | 10257000000891184 |

## 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。