

# 华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 18号

## 2023年第1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01月01日至2023年3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	107.09%
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
2023-03-31	1.0227	400,000,000.00	1.0227	409,093,082.75	1.38%
2022-12-31	1.0088	400,000,000.00	1.0088	403,513,043.01	

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	1.57%	1.70%
2	同业存单	0.00%	0.01%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	19.99%
5	非标准化债权类资产	81.10%	75.82%
6	权益类投资	0.00%	0.98%
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%	1.49%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	17.33%	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	140,623,835.23	32.10%
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	120,488,333.33	27.50%
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	58,068,421.73	13.25%
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	13,016,052.70	2.97%
5	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	7,432,591.19	1.70%
6	16 黔高速	债券	5,520,932.35	1.26%
7	21 凤凰 02	债券	3,780,901.20	0.86%
8	19 平安银行二级	债券	3,081,550.29	0.70%
9	21 首置 01	债券	2,911,981.92	0.66%
10	21 南方 01	债券	2,881,296.18	0.66%

### 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	148	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	153	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	175	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	147	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

本产品为封闭式理财产品，本报告期内未开放，产品持有 700 万以上的现金，可以应对一定的临时赎回，流动性风险可控。

### 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。根据公司内部理财风险资产分类的认定，持仓中 20 世茂 06（代码 175049.SH）的资产风险认定从正常类划分为关注类，该券在产品持仓中占比不高于 0.5%，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

本产品持有少量的权益类资产，主要为权益类公募基金、优先股及永续债，存在一定的市场风险，估值净价可能随市场波动。

#### 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。