

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 18号

2023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：2023年7月1日至2023年9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 | 111.38% |
| 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0390 | 400,000,000.00 | 1.0390 | 415,590,131.99 | 0.61% |
| 2023-06-30 | 1.0327 | 400,000,000.00 | 1.0327 | 413,084,512.69 | |

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值*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 | 0.46% | 1.03% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.06% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 2.57% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 63.22% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 24.05% | 21.63% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 0.64% |
| 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% | 10.86% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 75.49% | 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 | 中信信托.青岛城市建设投资集团.华 信 11 | 非标准化债权类 资产 | 100,125,707.46 | 21.63% |
| 2 | 21 拱墅 03 | 债券 | 16,906,077.26 | 3.65% |
| 3 | 安信鑫日享中短债债券 A | 公募基金 | 12,394,472.27 | 2.68% |
| 4 | 易方达稳健收益债券 B | 公募基金 | 12,309,438.80 | 2.66% |
| 5 | 债券买入返售 | 拆放同业及债券 买入返售 | 11,878,622.97 | 2.57% |
| 6 | 交银稳利中短债债券 A | 公募基金 | 11,478,022.27 | 2.48% |
| 7 | 20 首致 01 | 债券 | 11,059,871.56 | 2.39% |
| 8 | 21 火炬 02 | 债券 | 6,781,031.47 | 1.46% |
| 9 | 21 徐州新盛 PPN003 | 债券 | 6,743,042.92 | 1.46% |
| 10 | 21 鲁黄金 MTN002 | 债券 | 6,344,656.00 | 1.37% |

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 | 青岛城市建设投资(集团)有限责任公司 | 中信信托.青岛城市建设投资集团.华信 11 | 信托贷款 | 4.5400 | 65 | 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） |
|------------|-----------|----------|--------------|
| 国信证券股份有限公司 | 133647.SZ | 23 渝隆 04 | 3,968,421.11 |

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 | 每万份理财份额分红数（元） |
|------|---------------|
| - | - |

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品报告期内封闭，产品持有 4%左右的现金等高流动性资产，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

本产品报告期内持有的债券价格波动在合理范围。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品持有的权益资产为优先股和公募基金，市值随市场在合理范围内波动。

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。