

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 44 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	华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 44 号
理财产品代码	22131044
A 份额销售代码	22131044A
B 份额销售代码	22131044B
C 份额销售代码	22131044C
D 份额销售代码	22131044D
产品登记编码	Z7003922000033
产品募集方式	公募
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	125.51%
产品起始日期	2022-03-22
产品终止日期	2023-04-18

第二章 净值、存续规模及收益表现

A 份额：

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
2022-12-31	1.0144	916,628,258.00	1.0144	929,813,195.36	-0.29%
2022-09-30	1.0173	916,628,258.00	1.0173	932,466,729.91	

B 份额：

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
2022-12-31	1.0140	17,601,804.00	1.0140	17,848,046.74	-0.29%
2022-09-30	1.0170	17,601,804.00	1.0170	17,901,238.03	

C 份额：

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
2022-12-31	1.0124	79,537,354.00	1.0124	80,524,650.93	-0.34%
2022-09-30	1.0159	79,537,354.00	1.0159	80,805,359.20	

D 份额：

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
2022-12-31	1.0132	11,721,000.00	1.0132	11,875,728.79	-0.32%
2022-09-30	1.0165	11,721,000.00	1.0165	11,914,123.98	

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	0.89%	1.09%
2	同业存单	0.00%	3.37%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.12%
4	债券	0.00%	56.08%
5	非标准化债权类资产	41.01%	32.73%
6	权益类投资	0.00%	4.88%
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	0.36%	1.72%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	57.73%	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	北京市通州区国有资本运营有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	267,037,398.03	20.46%
2	肇庆新区投资发展有限公司理财融资项目(山东信托·圆泰 289)	非标准化债权类资产	80,123,143.92	6.14%
3	洛阳国晟投资控股集团有限公司理财融资项目(山东信托·融华 1 号.23/3/13 到期)	非标准化债权类资产	70,109,445.65	5.37%
4	工行优 1	权益类投资	55,859,318.97	4.28%
5	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	14,277,779.03	1.09%
6	方正富邦鑫益一年定期开放混合 A	公募基金	10,673,621.67	0.82%
7	潍坊城市建设发展投资集团有限公司 2022 年度第四期债权融资计划	非标准化债权类资产	10,015,243.34	0.77%
8	20 奉投 01	债券	8,103,961.46	0.62%
9	20 常新 01	债券	6,667,446.78	0.51%
10	GC 天成 01	债券	6,662,378.15	0.51%

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 年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.40	97	正常
2	肇庆新区投资发展有限公司	肇庆新区投资发展有限公司理财融资项目(山东信托·圆泰 289)	信托贷款	5.30	76	正常
3	洛阳国晟投资控股集团有限公司	洛阳国晟投资控股集团有限公司理财融资项目(山东信托·融华 1 号.23/3/13 到期)	信托贷款	5.00	72	正常
4	潍坊城市建设发展投资集团有限公司	潍坊城市建设发展投资集团有限公司 2022 年度第四期债权融资计划	债权融资计划	5.50	68	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	102282472.IB	22 胶州湾 MTN002	1,247,913.42
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	445,423.00

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）
英大基金管 理有限公司	650952 OTC	英大基金-华英稳健 3号集合资产管理计 划	买入	2,300,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19RI OTC	中诚信托汇鑫 12 号 集合资金信托计划	买入	1,500,000.00

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

本产品对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类、权益类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前组合流动性风险可控。

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

本产品持有债券资产信用展望稳定,成立以来债券收益率震荡向下,整体波动率仍处在合理区间范围内。

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

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	10257000000883322

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。