

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 44 号

2022 年年度报告

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、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本理财产品的财务报表进行了审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。
- 3、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 03 月 22 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	1.44%
2022-03-22	1.0000	-	1.0000	-	

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	1.40%
2022-03-22	1.0000	-	1.0000	-	

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	1.24%
2022-03-22	1.0000	-	1.0000	-	

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	1.32%
2022-03-22	1.0000	-	1.0000	-	

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%	54.83%
5	非标准化债权类资产	41.01%	32.73%
6	权益类投资	0.00%	6.13%
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	67	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	潍坊市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）
北京科技园建设（集团）股份有限公司	22 京科技园 PPN001A	032200226.IB	189,951.33
鲁能集团有限公司	22 鲁能 02	137819.SH	119,215.88

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	012281379.IB	22 盐城国投 SCP001	209,023.08
华夏银行股份有限公司	012281597.IB	22 长虹电子 SCP002	145,609.63
华夏银行股份有限公司	012281600.IB	22 盐城国投 SCP002	457,630.27
华夏银行股份有限公司	012283126.IB	22 新疆金投 SCP002	266,556.99
华夏银行股份有限公司	032280609.IB	22 赣能源 PPN001	1,533,550.76
华夏银行股份有限公司	032280716.IB	22 连云城建 PPN004	858,122.92
华夏银行股份有限公司	042280372.IB	22 武清国资 CP004	276,701.21
华夏银行股份有限公司	102280606.IB	22 京国资 MTN001	31,810.96
华夏银行股份有限公司	102280966.IB	22 国惠投资 MTN001A	408,209.12
华夏银行股份有限公司	102281333.IB	22 京电子城 MTN002	384,301.57
华夏银行股份有限公司	102281527.IB	22 长发集团 MTN002	149,014.73
华夏银行股份有限公司	102281864.IB	22 豫投资 MTN002	1,225,889.88
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
华夏银行股份有限公司	22CFZR0351	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	263,750,000.00

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）
英大保险资产管理有限	YD-HLYJ OTC	英大资产活利壹玖资产管理产品	买入	15,000,000.00

公司				
英大基金管理有限公司	000912 OTC	英大现金宝 A	买入	280,000,000.00
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	ZC19L1 OTC	中诚信托嘉信配置2 号集合资金信托计划	买入	16,000,000.00
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

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对可能出现的流动性风险。

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。但持仓中受市场因素影响，19 晋经 02（162757.SH）主体评级有所调整，发行人山西省经济建设投资集团有限公司 2022 年 6 月主体评级被上海新世纪资信评估投资服务有限公司由 AA 下调至 AA-。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品持有权益仓位价格波动对组合净值波动率的影响保持在可控范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品仓位。

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。

第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品存在违反相关法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。