

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 44 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	华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 44 号
理财产品代码	22121044
A 份额销售代码	22121044A
B 份额销售代码	22121044B
C 份额销售代码	22121044C
E 份额销售代码	22121044E
产品登记编码	Z7003922000152
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	100.19%
产品起始日期	2023-01-19
产品终止日期	2024-04-16

注：由于子份额可能存在募集金额或存续金额为 0，导致无持有人的情形，本报告仅列示报告期末存续金额不为 0 的相关子份额信息。

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
2023-09-30	1.0271	218,988,047.00	1.0271	224,918,529.64	1.07%
2023-06-30	1.0162	218,988,047.00	1.0162	222,545,065.85	

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
2023-09-30	1.0267	151,059,339.00	1.0267	155,093,384.73	1.05%
2023-06-30	1.0160	151,359,339.00	1.0160	153,783,738.24	

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
2023-09-30	1.0264	13,095,001.00	1.0264	13,440,283.36	1.04%
2023-06-30	1.0158	13,095,001.00	1.0158	13,301,798.37	

E 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
2023-09-30	1.0257	39,753.00	1.0257	40,772.89	1.02%
2023-06-30	1.0153	39,753.00	1.0153	40,362.66	

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	0.59%	1.19%
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%	55.65%
5	非标准化债权类资产	43.17%	43.17%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	56.24%	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	山东信托.滨州北海国有资产运营管理有限公司(融华 6 号)	非标准化债权类资产	100,101,832.75	25.39%
2	中诚信托.淮安市国有联合投资发展集团融资项目(诚晟 25 号第七期)第 2 期	非标准化债权类资产	40,046,621.12	10.16%
3	21 九龙 01	债券	33,945,557.89	8.61%
4	21 青控 02	债券	33,745,259.40	8.56%
5	22 宿迁经开 PPN002	债券	30,933,617.76	7.85%
6	21 桂交 01	债券	30,859,207.53	7.83%
7	中铁信托.青岛胶州城市发展投资有限公司(银杏 23010 期)第一期 0415 到期	非标准化债权类资产	30,031,124.09	7.62%
8	21 江高 01	债券	27,648,643.98	7.01%
9	21 桐控 01	债券	26,974,940.50	6.84%
10	21 惠金 01	债券	20,670,696.90	5.24%

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	滨州北海国有资产运营管理有限公司	山东信托.滨州北海国有资产运营管理有限公司(融华 6 号)	信托贷款	5.0170	195	正常
2	淮安市国有联合投资发展集团有限公司	中诚信托.淮安市国有联合投资发展集团融资项目(诚晟 25 号第七期)第 2 期	信托贷款	5.2334	164	正常
3	青岛胶州城市发展投资有限公司	中铁信托.青岛胶州城市发展投资有限公司(银杏 23010 期)第一期 0415 到期	信托贷款	5.1059	198	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

本产品为摊余成本法计价的封闭式理财产品，流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并根据产品的期限，合理安排各类资产久期，预防流动性风险。

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，产品持仓债券整体波动率表现符合摊余成本法资产计价特征。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

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	10250000003334467

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。