

# 华夏理财混合偏债周期300天理财产品A款

## 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    | 华夏理财混合偏债周期 300 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码  | 21214004                 |
| 产品登记编码  | Z7003921000301           |
| 产品募集方式  | 公募                       |
| 产品运作模式  | 开放式                      |
| 产品投资性质  | 混合类                      |
| 投资及收益币种 | 人民币                      |
| 产品风险评级  | PR3 级（中等风险）              |
| 杠杆水平    | 111.36%                  |
| 产品起始日期  | 2021-09-08               |
| 产品终止日期  | 无特定存续期限                  |

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)         | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)         | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2022-12-31 | 1.0201      | 247,174,000.39   | 1.0201      | 252,135,393.03   | 0.52%         |
| 2022-09-30 | 1.0148      | 3,802,140,946.13 | 1.0148      | 3,858,298,907.40 |               |

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       | 2.64%     | 51.31%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 1.23%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 3.79%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 40.01%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 0.30%     |
| 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          | 0.01%     | 3.35%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 97.35%    | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------|-----------------|----------------|-------------|
| 1  | 存款及清算款等现金类资产   | 现金及银行存款         | 144,079,732.31 | 51.31%      |
| 2  | 债券买入返售         | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 10,641,292.94  | 3.79%       |
| 3  | 20 江苏银行永续债     | 债券              | 2,904,181.00   | 1.03%       |
| 4  | 22 湘高速 MTN001  | 债券              | 2,882,786.90   | 1.03%       |
| 5  | 21 苏州银行 CD464  | 同业存单            | 2,820,448.17   | 1.00%       |
| 6  | 22 陕投集团 MTN003 | 债券              | 2,223,617.44   | 0.79%       |
| 7  | 20 招金 Y1       | 债券              | 2,005,822.45   | 0.71%       |
| 8  | 21 锡产业 MTN003  | 债券              | 1,994,831.13   | 0.71%       |
| 9  | 19 平安银行二级      | 债券              | 1,763,980.54   | 0.63%       |
| 10 | 16 黔高速         | 债券              | 1,704,916.25   | 0.61%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(天) | 风险状况 |
|----|------|------|------|------------|-------------|------|
| -  | -    | -    | -    | -          | -           | -    |

### 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 | 102282474.IB | 22 株国投 MTN002 | 144,152.28 |

#### 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）        |
|----------------|-----------------|----------------------------|------|----------------|
| 中诚信托有<br>限责任公司 | ZCXTJX03<br>OTC | 中诚信托嘉信配置3<br>号集合资金信托计<br>划 | 买入   | 241,000,000.00 |

## 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**

本产品配置了充足的现金及流动性资产，能够满足临时赎回的要求，流动性风险较小。

### **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**

本产品持有债券均为高信用评级债券，估值和信用风险较低，价格随着市场变化小幅波动。

#### **5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况**

本产品持有的权益类资产为公募基金及优先股。其中公募基金估值随市场变化有所波动，优先股估值较为稳定。

#### **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 | 10257000000870695 |

## **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。