

华夏理财混合偏债型一年定开理财产品 5 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	华夏理财混合偏债型一年定开理财产品 5 号
理财产品代码	21213105
A 份额销售代码	21213105A
B 份额销售代码	21213105B
产品登记编码	Z7003921000349
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	109.73%
产品起始日期	2021-12-10
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

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	0.9979	32,803,777.00	0.9979	32,733,527.40	0.07%
2022-09-30	0.9972	199,736,635.00	0.9972	199,184,071.19	

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	0.9985	17,059,500.00	0.9985	17,034,285.53	0.09%
2022-09-30	0.9976	199,504,100.00	0.9976	199,032,334.69	

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	7.97%	7.94%
2	同业存单	0.00%	2.13%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	15.17%
4	债券	0.00%	49.82%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	22.53%
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%	2.41%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	92.03%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	8,284,712.64	15.17%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	4,338,196.95	7.94%
3	21 深航空 MTN001	债券	1,676,283.42	3.07%
4	19 赣城投	债券	1,356,363.28	2.48%
5	22 住开 01	债券	1,287,949.37	2.36%
6	20 桂资 01	债券	1,270,061.72	2.33%
7	22 济南高新 SCP005	债券	1,267,044.48	2.32%
8	21 安邦债	债券	1,121,306.98	2.05%
9	21 动投 01	债券	1,103,683.23	2.02%
10	21 拱墅 03	债券	937,719.94	1.72%

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
-	-	-	-	-	-	-

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）
-	-	-	-

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 限责任公司	ZCXTJX03 OTC	中诚信托嘉信配置3 号集合资金信托计 划	买入	301,400,000.00

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

本产品在全年开放，提前将资产变现以支付赎回款。进入第二个封闭期后，保留了 7% 的现金及存款，可以应对临时赎回的要求。

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

产品持有 70% 以上的纯债资产，包括一部分银行二级资本债和永续债。四季度债券市场受到稳增长政策出台的刺激和理财产品赎回的压力，估值不断下跌，银行二级资本债和永续债的下跌幅度更大，拖累了产品净值。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的权益仓位价格波动对组合净值波动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。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000866293

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。