

华夏理财混合偏债型一年定开理财产品 3 号

2022 年第 1 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 01 月 01 日至 2022 年 3 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 3 号
理财产品代码	21213103
A 份额销售代码	21213103A
B 份额销售代码	21213103B
产品登记编码	Z7003921000347
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	101.93%
产品起始日期	2021-09-16
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
2022-03-31	0.9935	474,236,662.00	0.9935	471,135,663.80	-1.85%
2021-12-31	1.0122	474,236,662.00	1.0122	480,029,432.43	

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
2022-03-31	0.9940	466,858,563.00	0.9940	464,054,942.08	-1.83%
2021-12-31	1.0125	466,858,563.00	1.0125	472,698,451.45	

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	1.50%	5.38%
2	同业存单	0.00%	1.07%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.50%
4	债券	0.00%	18.69%
5	非标准化债权类资产	40.86%	40.11%
6	权益类投资	0.00%	1.90%
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	9.83%	32.36%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	47.81%	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	科学城(广州)投资集团有限公司 2021年第七期债权融资计划	非标准化债权类 资产	260,580,904.11	27.34%
2	北京市通州区国有资本运营 2021 年 第一期债权融资计划	非标准化债权类 资产	121,754,211.23	12.77%
3	现金及银行存款	现金及银行存款	51,242,093.68	5.38%
4	海富通欣利 C	公募基金	25,110,514.67	2.63%
5	国投瑞银安智 C	公募基金	20,130,851.46	2.11%
6	英大现金宝 A	公募基金	15,000,000.00	1.57%
7	华泰柏瑞富利 C	公募基金	9,302,765.17	0.98%
8	交银恒益灵活配置混合	公募基金	7,250,490.48	0.76%
9	19 农发 07	债券	7,005,208.30	0.73%
10	银华鑫盛灵活 C	公募基金	5,553,746.33	0.58%

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2021年第一期债权融资计划	债权融资计划	6.17	157	正常
2	科学城(广州)投资集团有限公司	科学城(广州)投资集团有限公司2021年第七期债权融资计划	债权融资计划	6.50	162	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	102280693.IB	22 临平城建 MTN001	284,380.94

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）
英大基金管理 有限公司	000912 OTC	英大现金宝 A	买入	15,000,000.00

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

本产品为定开型产品，在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，产品持有的现金等高流动性资产比例符合要求，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

截止本报告日，产品投资的债券资产外部评级未出现下调，展望稳定，债券价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

组合采用精选超额收益能力强的公募基金策略。2022 年股票市场波动较大，基金重仓股持续下跌，本产品在市场下跌中做了如下调整，一是增加了价值型风格基金占比，二是降低了持仓偏核心白马的基金占比。未来，本产品将按照产品说明书约定，为客户贡献权益市场收益。

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	10257000000857868

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。