

华夏理财混合偏债型一年半定开理财产品 4 号

2022 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：2022 年 07 月 01 日至 2022 年 09 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财混合偏债型一年半定开理财产品 4 号
理财产品代码	21213204
A 份额销售代码	21213204A
B 份额销售代码	21213204B
产品登记编码	Z7003921000365
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	107.50%
产品起始日期	2021-11-05
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
2022-09-30	0.9818	122,745,378.00	0.9818	120,512,704.62	-0.53%
2022-06-30	0.9870	122,745,378.00	0.9870	121,152,286.41	

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
2022-09-30	0.9823	87,415,013.00	0.9823	85,863,671.29	-0.51%
2022-06-30	0.9873	87,415,013.00	0.9873	86,308,486.19	

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	4.25%	4.78%
2	同业存单	0.00%	1.96%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.99%
4	债券	0.00%	41.17%
5	非标准化债权类资产	17.55%	16.33%
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%	32.77%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	78.20%	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	长兴港通建设开发有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	23,069,157.53	10.40%
2	青岛海发国有资本投资运营集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类资产	13,160,612.33	5.93%
3	中欧骏泰	公募基金	12,950,751.80	5.84%
4	长信长金通货币 A	公募基金	12,853,275.94	5.79%
5	现金及银行存款	现金及银行存款	10,604,788.46	4.78%
6	华夏中国交建高速 REIT	公募基金	6,907,909.60	3.11%
7	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	6,643,418.56	2.99%
8	建信中关村产业园 REIT	公募基金	5,419,004.00	2.44%
9	华夏越秀高速公路 REIT	公募基金	3,922,938.63	1.77%
10	22 蜀道投资 MTN002	债券	2,758,311.43	1.24%

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	青岛海发国有资本投资运营集团有限公司	青岛海发国有资本投资运营集团有限公司2022年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.30	182	正常
2	长兴港通建设开发有限公司	长兴港通建设开发有限公司2022年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.50	206	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）
首创证券股份有限公司	194874.SH	22 首证 01	402,401.04

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）
-	-	-	-	-

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

本产品在报告期内未开放，且持有 9%以上的高流动性资产，能够满足临时赎回的需要，流动性风险较低。

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 16%左右的非标准化债权资产，正常运行、价格波动较低。40%以上的标准化债券，久期在 1-2 年，信用等级较高，存在一定的估值风险。三季度债市收涨，为产品提供了较好的底仓收益。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品权益类资产均为公募基金，包括公募 REITs 基金。具有较高的市值波动风险。三季度权益市场震荡下跌，造成了净值的下跌。

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	10257000000866850

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。