

# 华夏理财混合偏债型一年定开理财产品 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定开理财产品 4 号 |
| 理财产品代码   | 21213104              |
| A 份额销售代码 | 21213104A             |
| B 份额销售代码 | 21213104B             |
| 产品登记编码   | Z7003921000348        |
| 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     | 119.75%               |
| 产品起始日期   | 2021-10-26            |
| 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<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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0179      | 182,903,854.00 | 1.0179      | 186,170,032.23 | -0.02%        |
| 2022-06-30 | 1.0181      | 182,903,854.00 | 1.0181      | 186,222,221.84 |               |

### B 份额：

| 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0183      | 104,846,798.00 | 1.0183      | 106,768,651.38 | -0.02%        |
| 2022-06-30 | 1.0185      | 104,846,798.00 | 1.0185      | 106,785,123.52 |               |

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       | 0.01%     | 1.55%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 5.10%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.49%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 67.40%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 6.75%     |
| 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          | 1.35%     | 18.70%    |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 98.64%    | 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  | 现金及银行存款        | 现金及银行存款 | 5,445,762.23 | 1.55%       |
| 2  | 上银优 1          | 权益类投资   | 4,559,339.46 | 1.30%       |
| 3  | 光大优 3          | 权益类投资   | 4,262,602.82 | 1.22%       |
| 4  | 杭银优 1          | 权益类投资   | 4,236,883.38 | 1.21%       |
| 5  | 招商沪深 300 地产 C  | 公募基金    | 4,107,931.78 | 1.17%       |
| 6  | 长银优 1          | 权益类投资   | 4,055,820.55 | 1.16%       |
| 7  | 21 中铁建 MTN001  | 债券      | 3,850,456.04 | 1.10%       |
| 8  | 21 国新 03       | 债券      | 3,810,950.42 | 1.09%       |
| 9  | 21 淄博城资 PRN001 | 债券      | 3,579,848.73 | 1.02%       |
| 10 | 工银瑞信金融地产 C     | 公募基金    | 3,542,209.87 | 1.01%       |

### 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）   |
|-------------------|--------------|-----------------|-----------|
| 北京科技园建设（集团）股份有限公司 | 032200226.IB | 22 京科技园 PPN001A | 38,779.62 |
| 鲁能集团有限公司          | 137819.SH    | 22 鲁能 02        | 34,124.53 |
| 首创证券股份有限公司        | 194874.SH    | 22 首证 01        | 76,390.39 |

#### 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 | 012283126.IB | 22 新疆金投 SCP002 | 33,848.58  |
| 华夏银行股份有限公司 | 032280716.IB | 22 连云城建 PPN004 | 245,630.36 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042280372.IB | 22 武清国资 CP004  | 35,799.47  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002 | 30,422.19  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281864.IB | 22 豫投资 MTN002  | 350,900.51 |

#### 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**

本产品持有债券比例较高，且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多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 | 10257000000866055 |

## **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。