

# 华夏理财混合偏债周期360天理财产品A款

## 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    | 华夏理财混合偏债周期 360 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码  | 2119187601               |
| 产品登记编码  | Z7003921000282           |
| 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    | 109.50%                  |
| 产品起始日期  | 2021-06-25               |
| 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 |
|------------|-------------|-------------------|-------------|-------------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0274      | 7,333,173,958.01  | 1.0274      | 7,534,290,334.46  | -0.29%        |
| 2022-06-30 | 1.0304      | 11,967,537,261.38 | 1.0304      | 12,331,707,838.79 |               |

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       | 1.28%     | 4.55%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 2.15%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.71%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 55.53%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 2.02%     |
| 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%     | 35.05%    |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 98.72%    | 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 | 375,427,348.99 | 4.55%       |
| 2  | 安信稳健增利混合 A      | 公募基金    | 254,475,558.67 | 3.08%       |
| 3  | 东方红策略精选混合 A     | 公募基金    | 148,859,258.75 | 1.80%       |
| 4  | 中欧瑾通 A          | 公募基金    | 117,789,477.67 | 1.43%       |
| 5  | 华夏睿磐泰利混合 A      | 公募基金    | 96,697,127.27  | 1.17%       |
| 6  | 交银瑞鑫定期开放灵活配置混合  | 公募基金    | 95,158,095.34  | 1.15%       |
| 7  | 鹏华兴惠定期开放混合      | 公募基金    | 81,646,721.25  | 0.99%       |
| 8  | 交银周期回报灵活配置混合 A  | 公募基金    | 77,760,443.37  | 0.94%       |
| 9  | 交银多策略回报灵活配置混合 A | 公募基金    | 77,697,094.05  | 0.94%       |
| 10 | 交银新回报灵活配置混合 A   | 公募基金    | 73,528,345.31  | 0.89%       |

### 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 | 3,558,394.55 |
| 鲁能集团有限公司          | 137819.SH    | 22 鲁能 02        | 1,834,481.15 |

#### 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 | 1,854,130.32 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032200240.IB | 22 徐州经开 PPN002 | 4,316,795.62 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032280716.IB | 22 连云城建 PPN004 | 1,005,659.18 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042280372.IB | 22 武清国资 CP004  | 2,141,501.68 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102200189.IB | 22 知识城 MTN006  | 468,455.92   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002 | 1,402,023.32 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281669.IB | 22 武汉生态 MTN001 | 555,963.94   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281789.IB | 22 武汉生态 MTN002 | 3,484,886.04 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281864.IB | 22 豫投资 MTN002  | 1,436,655.97 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281971.IB | 22 桂铁投 MTN005  | 827,649.71   |

#### 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**

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,按照产品说明书约定确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例,并随着风险收益特征的相对变化及时调整;此外,本产品通过分散投资、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。

### **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**

本产品按照产品说明书约定的范围进行投资,并根据市场行情,调整各类资产的占比。结合产品所投资公募基金的持仓情况,由于产品固定收益类资产配置占比超过 60%,产品运作管理期间净值波动幅度较小。

#### **5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况**

本产品严格按照产品说明书约定进行资产配置,三季度在市场不利的情况下严格控制权益类资产穿透后的股票持仓,并依靠占比较高的固定收益类资产收益,减小理财产品的回撤,降低客户损失。

#### **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 | 10257000000867275 |

## **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。