

华夏理财混合偏债型一年半定开理财产品 3 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半定开理财产品 3 号
理财产品代码	21213203
A 份额销售代码	21213203A
B 份额销售代码	21213203B
产品登记编码	Z7003921000364
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	140.05%
产品起始日期	2021-10-19
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	0.9963	94,627,824.00	0.9963	94,273,683.06	-1.63%
2022-09-30	1.0128	94,627,824.00	1.0128	95,834,881.98	

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	0.9969	38,697,695.00	0.9969	38,576,009.33	-1.61%
2022-09-30	1.0132	38,697,695.00	1.0132	39,209,896.32	

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	2.07%	2.09%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.53%
4	债券	0.00%	92.21%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.24%
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	6.48%	4.93%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	91.45%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	3,892,896.56	2.09%
2	21 江南农商永续债	债券	3,389,975.42	1.82%
3	21 郑州银行永续债	债券	3,269,050.96	1.76%
4	21 厦门国际银行永续债 01	债券	3,033,264.84	1.63%
5	22 扬子国资 MTN001	债券	2,674,981.14	1.44%
6	21 铁沪 Y2	债券	2,619,881.60	1.41%
7	21 川能 Y1	债券	2,068,855.24	1.11%
8	21 铁隧 Y1	债券	1,974,199.92	1.06%
9	19 民生银行二级 01	债券	1,654,697.90	0.89%
10	20 天成租赁 GN003	债券	1,449,934.97	0.78%

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）
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	173,006.77
华夏银行股份有限公司	2220071.IB	22 苏州银行小微债	414,279.55

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）
-	-	-	-	-

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。

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评级稳定，债券价格自 11 月份起出现较大波动，产品净值受到影响。下一步拟逐步优化组合结构，将产品的久期、杠杆控制在更优状态。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

产品股票部分主要通过公募基金投资。四季度股票市场收涨，逐步走出底部区域。本产品在组合角度注重风格均衡，仓位把握稳健，在 10 月份进一步降低了仓位，11-12 月逐步增加了仓位配置，部分对冲了债券价格的波动。未来拟进一步根据市场情况动态调整。

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	10257000000857336

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。