

# 华夏理财混合偏债型一年定开理财产品 4 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     | 113.38%               |
| 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-12-31 | 1.0099      | 19,966,877.08  | 1.0099      | 20,164,912.00  | -0.79%        |
| 2022-09-30 | 1.0179      | 182,903,854.00 | 1.0179      | 186,170,032.23 |               |

### 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-12-31 | 1.0106      | 15,792,663.59  | 1.0106      | 15,960,104.06  | -0.76%        |
| 2022-09-30 | 1.0183      | 104,846,798.00 | 1.0183      | 106,768,651.38 |               |

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       | 1.13%     | 1.24%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 1.39%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 5.42%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 52.27%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 41.35%    | 36.49%    |
| 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%     | 3.19%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 57.53%    | 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  | 山东信托·洛阳国晟1017到期(融华1号) | 非标准化债权类资产       | 14,945,500.00 | 36.49%      |
| 2  | 债券买入返售                | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 2,221,682.18  | 5.42%       |
| 3  | 存款及清算款等现金类资产          | 现金及银行存款         | 508,976.04    | 1.24%       |
| 4  | 19 平安银行二级             | 债券              | 440,605.86    | 1.08%       |
| 5  | 16 黔高速                | 债券              | 425,852.82    | 1.04%       |
| 6  | 19 交通银行二级 01          | 债券              | 379,390.63    | 0.93%       |
| 7  | 20 江苏银行永续债            | 债券              | 342,490.86    | 0.84%       |
| 8  | 22 湘高速 MTN001         | 债券              | 339,967.85    | 0.83%       |
| 9  | 21 苏州银行 CD464         | 同业存单            | 332,616.23    | 0.81%       |
| 10 | 21 深航空 MTN001         | 债券              | 331,089.13    | 0.81%       |

### 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  | 洛阳国晟投资控股集团有限公司 | 山东信托.洛阳国晟 1017 到期(融华 1 号) | 信托贷款 | 5.00   | 290     | 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） |
|-------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -       |

#### 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

本产品在开放期之前对资产进行变现，顺利应对了开放期的赎回，在重新封闭后，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

本产品主要通过公募基金参与权益市场的投资，产品投资的公募基金价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 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。