

# 华夏理财混合偏债型一年定开理财产品 5 号

## 2022 年第 2 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 04 月 01 日至 2022 年 6 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 5 号
理财产品代码	21213105
A 份额销售代码	21213105A
B 份额销售代码	21213105B
产品登记编码	Z7003921000349
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	126.55%
产品起始日期	2021-12-10
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
2022-06-30	1.0004	199,736,635.00	1.0004	199,817,256.69	1.80%
2022-03-31	0.9827	199,746,635.00	0.9827	196,290,434.59	

### 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
2022-06-30	1.0007	199,504,100.00	1.0007	199,639,874.92	1.82%
2022-03-31	0.9828	199,504,100.00	0.9828	196,081,913.69	

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	0.80%	2.26%
2	同业存单	0.00%	4.14%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.15%
4	债券	0.00%	73.76%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.23%
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%	19.45%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.20%	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	现金及银行存款	现金及银行存款	11,436,567.15	2.26%
2	19 平安银行二级	债券	10,224,654.49	2.02%
3	19 交通银行二级 01	债券	9,790,029.68	1.94%
4	16 黔高速	债券	8,536,492.55	1.69%
5	22 蜀道投资 MTN002	债券	6,641,572.63	1.31%
6	20 广州地铁 MTN004	债券	6,388,163.44	1.26%
7	22 建设银行 CD040	同业存单	5,865,946.91	1.16%
8	21 郑州经开 MTN001	债券	5,735,856.00	1.13%
9	19 桂纾 01	债券	5,303,852.63	1.05%
10	21 凤凰 01	债券	5,246,098.94	1.04%

### 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	012281597.IB	22 长虹电子 SCP002	158,738.54
华夏银行股份有限公司	102281113.IB	22 鄂交通 MTN002	878,815.32
华夏银行股份有限公司	102281333.IB	22 京电子城 MTN002	30,876.59

#### 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）
英大基金管理 有限公司	ydhywj02 OTC	英大基金-华英稳健 2号集合资产管理计 划	买入	5,000,000.00

## 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

本产品报告期内未开放，且持有 6%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 70%以上的债券，久期在 1-2 年，信用等级较高，采用市值法估值，具有一定的价格波动风险。二季度债券市场震荡微跌，收益贡献降低。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

产品无股票直接持仓，均为公募基金，风格为均衡偏价值，具有较高的市值波动风险。由于权益市场二季度出现深 V 反转，为组合贡献较大弹性。

#### 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	10257000000866293

## 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。