

华夏理财混合偏债型一年半定开理财产品 2 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 2 号
理财产品代码	211928700302
产品登记编码	Z7003921000145
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	127.29%
产品起始日期	2021-08-26
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

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	1.0244	158,521,944.00	1.0244	162,395,444.60	-1.50%
2022-09-30	1.0400	158,521,944.00	1.0400	164,856,062.22	

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	1.06%	1.48%
2	同业存单	0.00%	4.63%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.30%
4	债券	0.00%	85.31%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
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%	6.27%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	98.94%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	4,762,989.88	2.30%
2	21 拱墅 03	债券	4,305,962.11	2.08%
3	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	3,063,380.44	1.48%
4	22 联优 02	债券	2,319,848.11	1.12%
5	21 郑州经开 MTN001	债券	2,207,091.46	1.07%
6	21 德邦 C1	债券	2,188,914.30	1.06%
7	22 义乌 01	债券	2,178,820.68	1.05%
8	21 平证 Y1	债券	2,086,052.60	1.01%
9	易方达恒久 1 年定期债券 A	公募基金	2,077,736.92	1.01%
10	21 北部湾 MTN002	债券	2,066,720.04	1.00%

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	63,711.21

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

本产品在报告期内未开放，持有 700 万以上的高流动性资产，能够应对临时赎回的风险。

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

本产品持有 80%以上的纯债资产，包括一部分银行永续债和二级资本债。四季度受到稳增长政策出台的触发和银行理财赎回的影响，债券估值波动较大，特别是银行永续债和二级资本债，下跌幅度更大，对净值带来了负向作用。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有 6%以上的混合类公募基金。四季度权益市场下跌 2 个月后开始反弹，整体看公募基金净值下跌。

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	10257000000857325

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。