

华夏理财混合偏债型一年定开理财产品 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定开理财产品 2 号
理财产品代码	21213102
A 份额销售代码	21213102A
B 份额销售代码	21213102B
产品登记编码	Z7003921000346
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	109.13%
产品起始日期	2021-09-07
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	1.0070	51,365,675.15	1.0070	51,726,003.50	-0.29%
2022-09-30	1.0099	51,365,675.15	1.0099	51,871,720.48	

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	1.0085	28,729,000.00	1.0085	28,972,205.59	-0.26%
2022-09-30	1.0111	28,729,000.00	1.0111	29,046,500.60	

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	1.78%	1.95%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.33%
4	债券	0.00%	45.17%
5	非标准化债权类资产	44.40%	40.71%
6	权益类投资	0.00%	0.14%
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%	9.69%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	53.82%	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	百瑞信托·金水(青岛)供应链管理有 限公司理财融资项目(百瑞恒益 1163 号)	非标准化债权类 资产	35,855,046.00	40.71%
2	20 济金控	债券	2,999,820.61	3.41%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	2,054,318.88	2.33%
4	20 济宁 01	债券	1,926,925.11	2.19%
5	20 信达地产 MTN001	债券	1,779,443.69	2.02%
6	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,717,753.58	1.95%
7	20 衡阳城投 PPN003	债券	1,250,182.39	1.42%
8	16 国开 07	债券	1,200,245.52	1.36%
9	交银优择回报灵活配置混合 A	公募基金	1,152,685.00	1.31%
10	21 广州银行二级	债券	1,131,230.58	1.28%

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	金水(青岛)供应链管理有限公司	百瑞信托·金水(青岛)供应链管理有限公司理财融资项目(百瑞恒益 1163 号)	信托贷款	5.02	243	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）
华夏银行股份有限公司	102282213.IB	22 义乌国资 MTN005	209,766.61

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）
英大基金管理 有限公司	650958 OTC	英大基金-华英价值 1 号集合资产管理计 划	买入	1,000,000.00

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

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信用展望稳定，债券价格波动处于市场合理区间范围内。

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

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000857290

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。