

# 华夏理财混合偏债型一年半定开理财产品 6 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半定开理财产品 6 号 |
| 理财产品代码   | 21213206               |
| A 份额销售代码 | 21213206A              |
| 产品登记编码   | Z7003921000367         |
| 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     | 105.06%                |
| 产品起始日期   | 2021-11-24             |
| 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<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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-06-30 | 0.9978      | 268,021,774.00 | 0.9978      | 267,426,345.78 | 1.23%         |
| 2022-03-31 | 0.9857      | 268,021,774.00 | 0.9857      | 264,178,972.93 |               |

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       | 6.85%     | 7.78%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.58%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 25.04%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 45.17%    | 43.01%    |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 1.81%     |
| 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          | 12.98%    | 21.78%    |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 35.01%    | 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  | 湖州吴兴城市投资发展集团有限公司 2021 年度第四期债权融资计划 | 非标准化债权类<br>资产 | 120,840,328.77 | 43.01%      |
| 2  | 现金及银行存款                           | 现金及银行存款       | 21,856,747.33  | 7.78%       |
| 3  | 安信稳健增利 C                          | 公募基金          | 8,433,595.39   | 3.00%       |
| 4  | 交银施罗德恒益灵活配置混合 C                   | 公募基金          | 8,287,204.30   | 2.95%       |
| 5  | 国富安享                              | 公募基金          | 7,004,987.49   | 2.49%       |
| 6  | 国投瑞银瑞利                            | 公募基金          | 3,281,212.25   | 1.17%       |
| 7  | 英大现金宝 A                           | 公募基金          | 2,101,364.21   | 0.75%       |
| 8  | 中泰星元价值优选 C                        | 公募基金          | 1,663,937.81   | 0.59%       |
| 9  | 信达澳银周期动力混合 C                      | 公募基金          | 1,567,314.20   | 0.56%       |
| 10 | 交银趋势优先 C                          | 公募基金          | 1,270,722.08   | 0.45%       |

### 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  | 湖州吴兴城市投资发展集团有限公司 | 湖州吴兴城市投资发展集团有限公司 2021 年度第四期债权融资计划 | 债权融资计划 | 6.50   | 319     | 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 | 012281600.IB | 22 盐城国投 SCP002 | 66,178.76  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281181.IB | 22 胶州湾 MTN001  | 53,900.82  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281333.IB | 22 京电子城 MTN002 | 108,816.03 |

#### 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） |
|-------|------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -    | -       |

## 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，产品持有的现金等高流动性资产比例符合要求，组合流动性风险可控。

### 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外部评级未出现下调，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

组合采用精选超额收益能力强的公募基金策略。2022 年股票市场波动较大，二季度市场深 V 型反转，本产品在市场宽幅震荡中做了如下调整，一是增加了成长风格基金占比，二是市场上涨过程中小幅减仓。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

## 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号              |
|----|------|-------------------|
| 1  | 托管账户 | 10257000000874850 |

## 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。