

华夏理财混合偏债型封闭式理财产品 11 号

2022 年半年度报告

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 01 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封闭式理财产品 11 号
理财产品代码	21211011
A 份额销售代码	21211011A
B 份额销售代码	21211011B
产品登记编码	Z7003921000726
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式
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	103.97%
产品起始日期	2021-12-21
产品终止日期	2023-06-14

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	0.9929	122,646,674.00	0.9929	121,770,584.56	-0.80%
2021-12-31	1.0009	122,646,674.00	1.0009	122,760,606.16	

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	0.9931	110,994,236.00	0.9931	110,230,220.98	-0.78%
2021-12-31	1.0009	110,994,236.00	1.0009	111,098,865.43	

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	2.35%	6.10%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	16.00%
4	债券	0.00%	12.82%
5	非标准化债权类资产	44.52%	42.88%
6	权益类投资	0.00%	14.19%
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%	8.02%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	53.13%	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	河南东龙控股集团有限公司 2022 年 第二期债权融资计划	非标准化债权类 资产	103,421,244.15	42.88%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	38,582,831.70	16.00%
3	现金及银行存款	现金及银行存款	14,707,505.43	6.10%
4	华宝现金添益 A	公募基金	5,595,081.20	2.32%
5	银华交易型货币 A	公募基金	5,588,963.00	2.32%
6	新莱应材	权益类投资	2,282,271.65	0.95%
7	丽珠集团	权益类投资	2,242,004.62	0.93%
8	华海药业	权益类投资	2,192,875.09	0.91%
9	19 常高 06	债券	1,921,234.21	0.80%
10	银华交易货币 B	公募基金	1,917,984.91	0.80%

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	河南东龙控股集团有限公司	河南东龙控股集团有限公司 2022 年第二期 债权融资计划	债权融资 计划	5.30	347	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	22CFZR0322	河南东龙控股集团有限公司 2022 年度第二期债权融资计划	103,500,000.00

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

本产品以债券等固收类资产为主要投资标的，追求稳健回报，同时精选权益基金，为组合谋求收益增强。

本产品固收部分主要投向资管计划以及债券，同时根据市场行情变化，动态调整相关资产的比例，平衡产品投资收益以及流动性。穿透资管计划，本产品投资的资管计划底层债券资产以 AA 以上评级债券为主，品种上以城投债以及国有企业债券为主。本产品权益部分主要投向资产管理计划以及权益型、混合型公募基金和 FOF 产品，通过自上而下和中观行业策略，结合基金评价和精选策略，努力控制产品净值回撤，力争获取超额收益。

本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，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，产品持仓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

截止本报告日，产品投资的权益类资产受市场波动影响，出现一定回调，产品严格按照产品说明书约定，灵活进行了仓位调整，尽量控制产品净值波动。

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	10257000000857392

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。

第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品
在投资运作过程中存在违反法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。