

华夏理财混合偏债型封闭式理财产品 2 号

2022 年第 3 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 07 月 01 日至 2022 年 09 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 2 号
理财产品代码	211929700102
A 份额销售代码	211929700102A
B 份额销售代码	211929700102B
产品登记编码	Z7003921000165
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	103.78%
产品起始日期	2021-12-14
产品终止日期	2022-12-14

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
2022-09-30	0.9979	118,669,166.00	0.9979	118,420,481.68	-0.27%
2022-06-30	1.0006	118,669,166.00	1.0006	118,744,677.01	

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
2022-09-30	0.9983	76,920,846.00	0.9983	76,790,149.82	-0.26%
2022-06-30	1.0009	76,920,846.00	1.0009	76,990,671.51	

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	1.96%	2.38%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.45%
4	债券	0.00%	37.52%
5	非标准化债权类资产	47.95%	46.27%
6	权益类投资	0.00%	5.84%
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%	5.54%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	50.09%	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	清水塘流动资金贷款集合资金信托 计划第二期	非标准化债权类 资产	93,737,802.84	46.27%
2	海富通中证短融 ETF	公募基金	7,053,910.91	3.48%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	4,959,773.35	2.45%
4	现金及银行存款	现金及银行存款	4,826,234.29	2.38%
5	22 附息国债 10	债券	3,428,842.67	1.69%
6	19 启东 03	债券	2,971,942.42	1.47%
7	20 衡阳城投 PPN003	债券	2,372,110.01	1.17%
8	21 广州银行二级	债券	2,199,123.79	1.09%
9	19 中国银行二级 03	债券	2,055,594.50	1.01%
10	20 国开 02	债券	1,945,148.95	0.96%

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	株洲清水塘投资集团有限公司	清水塘流动资金贷款集合资金信托计划第二期	信托贷款	5.96	70	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）
-	-	-	-

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

5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优，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，产品净值波动较低。

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	10257000000857369

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。