

# 华夏理财混合偏债型封闭式理财产品 12 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 12 号
理财产品代码	21211012
产品登记编码	Z7003921000727
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	104.90%
产品起始日期	2022-01-26
产品终止日期	2024-02-05

## 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
2022-09-30	1.0057	194,562,921.00	1.0057	195,663,275.04	-0.99%
2022-06-30	1.0158	194,572,921.00	1.0158	197,644,516.57	

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	0.00%	2.54%
2	同业存单	0.00%	0.39%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.17%
4	债券	0.00%	25.06%
5	非标准化债权类资产	43.75%	41.80%
6	权益类投资	0.00%	3.62%
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	4.60%	25.43%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	51.65%	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	郑州公共住宅建设投资有限公司 2022 年第一期	非标准化债权类 资产	85,796,103.53	41.80%
2	现金及银行存款	现金及银行存款	5,219,197.25	2.54%
3	景顺长城景颐双利 A	公募基金	4,066,832.37	1.98%
4	富国中债 7-10 年政策性金融债 ETF	公募基金	3,577,750.17	1.74%
5	永赢稳益债券	公募基金	3,520,317.79	1.72%
6	富国泓利纯债 A	公募基金	3,249,312.34	1.58%
7	富国天利增长债券	公募基金	2,637,239.48	1.28%
8	交银裕隆纯债债券 A	公募基金	2,603,071.80	1.27%
9	富国信用债债券 A	公募基金	2,491,704.29	1.21%
10	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	2,400,665.81	1.17%

### 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	郑州公共住宅建设投资有限公司	郑州公共住宅建设投资有限公司 2022 年第一期	债权融资计划	5.80	469	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）
北京科技园建设（集团） 股份有限公司	032200226.IB	22 京科技园 PPN001A	49,118.70
鲁能集团有限公司	137819.SH	22 鲁能 02	45,465.01

#### 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	042280372.IB	22 武清国资 CP004	44,167.68

#### 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

本产品为封闭式产品，在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，相应配置货币类、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，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

本产品持有的债券及债券型基金总体信用风险可控。三季度，经济基本面修复仍然面临众多挑战，货币政策维持宽松态势，并在8月中旬下调OMO利率，推动十年国债收益率下行。但随着降息带来的做多情绪逐步弱化，叠加稳增长政策加码，9月初以来债市以回调为主。总体来讲，本季度市场利率走势呈先下后上的形态。信用债方面，违约依然集中在民营房地产主体，违约率处于近两年高位。报告期内，产品持仓债券整体上涨。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品未直接持有股票，主要通过权益或混合类公募基金参与权益市场的投资。三季度，海内外不确定性交织共振，海外方面，美国通胀率超预期，联储加息态度强硬，人民币汇率承压；国内方面，疫情呈现多点散发式布局，打乱经济修复节奏，7月份房地产市场发生“断供”风波，地产下行压力凸显。在此背景下，权益市场呈现震荡下行走势，且回调幅度较大。本产品对持仓结构进行了调整，择机降低权益仓位，控制产品净值回撤幅度。

#### 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	10257000000857405

## 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。