

华夏理财混合偏债型一年半定开理财产品 5 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一年半定开理财产品 5 号
理财产品代码	21213205
产品登记编码	Z7003921000366
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	108.58%
产品起始日期	2022-02-15
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 (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	1.0065	296,494,323.00	1.0065	298,415,933.01	-0.56%
2022-06-30	1.0122	296,494,323.00	1.0122	300,125,092.03	

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	0.91%	1.22%
2	同业存单	0.00%	0.92%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.70%
4	债券	0.00%	46.25%
5	非标准化债权类资产	41.39%	38.13%
6	权益类投资	0.00%	0.00%
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%	12.77%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	57.70%	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	粤财信托.成都香投集合资金信托计划	非标准化债权类 资产	63,191,362.50	19.50%
2	潍坊市城市建设发展投资集团有限公司 2022 年度第二期理财直接融资工具	非标准化债权类 资产	30,343,315.07	9.36%
3	渤海信托.淮北建投商贸理财融资项目(2022 金雀 108 号)	非标准化债权类 资产	30,025,333.33	9.27%
4	19 平安银行二级	债券	4,121,997.50	1.27%
5	招商沪深 300 地产 C	公募基金	4,054,227.69	1.25%
6	现金及银行存款	现金及银行存款	3,950,151.86	1.22%
7	19 交通银行二级 01	债券	3,801,767.25	1.17%
8	16 黔高速	债券	3,311,259.91	1.02%
9	20 广州地铁 MTN004	债券	2,570,974.50	0.79%
10	华宝中证全指证券公司 ETF	公募基金	2,353,572.45	0.73%

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	淮北市建投商贸有限公司	渤海信托.淮北建投商贸理财融资项目(2022金雀 108 号)	信托贷款	5.20	304	正常
2	潍坊市城市建设发展投资集团有限公司	潍坊市城市建设发展投资集团有限公司 2022 年度第二期理财直接融资工具	理财直接融资工具	5.50	211	正常
3	成都香城投资集团有限公司	粤财信托.成都香投集合资金信托计划	信托贷款	5.35	267	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）
首创证券股份有限公司	194874.SH	22 首证 01	1,192,168.30

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

本产品在报告期内未开放，持有的高流动性资产能够满足临时赎回的需要，流动性风险较低。

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 38%左右的非标准化债权资产，正常运行、价格波动较低。46%以上的标准化债券，久期在 1-2 年，信用等级较高，存在一定的估值风险。三季度债券市场收涨，为产品贡献了较好的底仓收益。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品无股票直接持仓，均为公募基金，风格为均衡偏价值，具有较高的市值波动风险。由于权益市场三季度震荡下跌，造成了产品净值的下降。

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	10257000000866861

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。