

华夏理财混合偏债型封闭式理财产品 11 号

2022 年第 4 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 10 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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	111.37%
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
2022-12-31	0.9966	122,646,674.00	0.9966	122,232,742.13	0.76%
2022-09-30	0.9891	122,646,674.00	0.9891	121,314,891.99	

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
2022-12-31	0.9971	110,994,236.00	0.9971	110,676,471.81	0.77%
2022-09-30	0.9895	110,994,236.00	0.9895	109,831,556.45	

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	0.62%	4.89%
2	同业存单	0.00%	2.78%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.24%
4	债券	0.00%	47.10%
5	非标准化债权类资产	44.36%	39.89%
6	权益类投资	0.00%	2.23%
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%	1.87%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	55.02%	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	103,470,730.76	39.89%
2	20 衡阳城投 PPN003	债券	3,669,535.14	1.41%
3	21 广州银行二级	债券	3,320,387.79	1.28%
4	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	3,209,374.38	1.24%
5	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	3,132,949.56	1.21%
6	19 武汉城投 PPN001	债券	2,336,119.24	0.90%
7	19 锡交通 PPN001	债券	2,188,174.63	0.84%
8	他行存款	现金及银行存款	2,022,047.12	0.78%
9	20 乐山国资 PPN002	债券	1,836,560.83	0.71%
10	20 空港城发 PPN001	债券	1,723,662.20	0.66%

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	163	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	102282474.IB	22 株国投 MTN002	22,275.42

3.4.3 报告期内其他关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	交易金额（元）
英大基金管理 有限公司	650959 OTC	英大基金-华英价值 2 号集合资产管理计 划	买入	7,000,000.00

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,按照产品说明书约定确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例,并随着风险收益特征的相对变化及时调整;此外,本产品通过分散投资、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。

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

本产品按照产品说明书约定的范围进行投资,并根据市场行情,调整各类资产的占比。结合产品所投资公募基金的持仓情况,由于产品固定收益类资产配置占比超过 60%,产品运作管理期间净值波动幅度较小。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品严格按照产品说明书约定进行资产配置,持有的权益类资产为公募基金及优先股,四季度在市场极其不利的情况下及时降低权益资产的比例,严格控制股票持仓占比,并依靠权益市场择时能力及非标资产为投资者提供了一定的正收益。

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	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。