

# 华夏理财混合偏债型一年半定开理财产品 6 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一年半定开理财产品 6 号 |
| 理财产品代码   | 21213206               |
| A 份额销售代码 | 21213206A              |
| 产品登记编码   | Z7003921000367         |
| 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     | 109.01%                |
| 产品起始日期   | 2021-11-24             |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-12-31 | 0.9974      | 268,021,774.00 | 0.9974      | 267,314,835.91 | 0.28%         |
| 2022-09-30 | 0.9946      | 268,021,774.00 | 0.9946      | 266,563,128.76 |               |

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       | 0.08%     | 5.73%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 3.51%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 1.10%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 41.46%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 44.82%    | 41.13%    |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 1.83%     |
| 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%     | 5.24%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 55.10%    | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|-----------------------------------|-----------------|----------------|-------------|
| 1  | 湖州吴兴城市投资发展集团有限公司 2021 年度第四期债权融资计划 | 非标准化债权类<br>资产   | 119,865,698.63 | 41.13%      |
| 2  | 债券买入返售                            | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 3,192,893.28   | 1.10%       |
| 3  | 他行存款                              | 现金及银行存款         | 3,033,819.39   | 1.04%       |
| 4  | 他行存款                              | 现金及银行存款         | 2,560,600.28   | 0.88%       |
| 5  | 存款及清算款等现金类资产                      | 现金及银行存款         | 2,346,129.15   | 0.81%       |
| 6  | 20 衡阳城投 PPN003                    | 债券              | 1,719,479.88   | 0.59%       |
| 7  | 22 惠科 02                          | 债券              | 1,700,455.04   | 0.58%       |
| 8  | 他行存款                              | 现金及银行存款         | 1,685,455.22   | 0.58%       |
| 9  | 他行存款                              | 现金及银行存款         | 1,684,838.01   | 0.58%       |
| 10 | 22 农业银行 CD055                     | 同业存单            | 1,665,676.97   | 0.57%       |

### 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  | 湖州吴兴城市投资发展集团有限公司 | 湖州吴兴城市投资发展集团有限公司 2021 年度第四期债权融资计划 | 债权融资计划 | 6.50   | 135     | 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 | 42,729.24 |

#### 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<br>理有限公司 | 000912 OTC | 英大现金宝 A                      | 买入   | 8,000,000.00  |
| 英大基金管<br>理有限公司 | 650959 OTC | 英大基金-华英价值<br>2 号集合资产管理计<br>划 | 买入   | 11,000,000.00 |

## 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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，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，产品投资的债券资产信用展望稳定，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

截至本报告日，产品投资的权益资产价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 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 | 10257000000874850 |

## **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。