

华夏理财混合偏债型封闭式理财产品 1 号

2022 年半年度报告

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 01 月 01 日至 2022 年 6 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 1 号
理财产品代码	21211001
A 份额销售代码	21211001A
B 份额销售代码	21211001B
产品登记编码	Z7003921000723
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	104.29%
产品起始日期	2021-12-22
产品终止日期	2022-12-22

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
2022-06-30	0.9929	303,672,565.00	0.9929	301,503,459.78	-0.84%
2021-12-31	1.0013	303,672,565.00	1.0013	304,078,311.71	

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
2022-06-30	0.9931	175,630,081.00	0.9931	174,420,964.39	-0.82%
2021-12-31	1.0013	175,630,081.00	1.0013	175,866,913.89	

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	4.92%	7.41%
2	同业存单	0.00%	1.13%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.15%
4	债券	0.00%	24.08%
5	非标准化债权类资产	39.50%	37.93%
6	权益类投资	0.00%	2.18%
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	9.18%	26.13%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	46.40%	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	太原重型机械集团有限公司 2021 年 度第三期债权融资计划	非标准化债权类 资产	150,198,597.35	30.26%
2	陕西西咸新区城建投资集团有限公 司 2021 年第二期债权融资计划	非标准化债权类 资产	38,048,998.79	7.67%
3	现金及银行存款	现金及银行存款	36,760,278.05	7.41%
4	国富安享	公募基金	11,008,234.77	2.22%
5	安信稳健增利 C	公募基金	8,454,440.63	1.70%
6	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	5,728,741.99	1.15%
7	国投瑞银瑞利	公募基金	5,168,868.53	1.04%
8	华安新优选灵活配置混合 C	公募基金	4,793,616.52	0.97%
9	安信稳健增利混合 A	公募基金	4,360,621.08	0.88%
10	安信新目标混合 C	公募基金	3,786,937.84	0.76%

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	陕西西咸新区城建投资集团有限公司	陕西西咸新区城建投资集团有限公司 2021 年第二期债权融资计划	债权融资计划	5.88	166	正常
2	太原重型机械集团有限公司	太原重型机械集团有限公司 2021 年度第三期债权融资计划	债权融资计划	5.50	172	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	012281600.IB	22 盐城国投 SCP002	238,415.56
华夏银行股份有限公司	102280693.IB	22 临平城建 MTN001	328,349.85

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、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,产品持有的现金等高流动性资产比例符合要求,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

截止本报告日,产品持仓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

组合采用精选超额收益能力强的公募基金策略。2022 年股票市场波动较大,一季度市场持续下跌、二季度市场深 V 型反转,本产品在一季度市场反弹时持续降仓,二季度底部加仓成长,并随成长上涨陆续减仓。未来拟进一步根据市场情况动态调整。

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	10257000000857074

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。

第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品存在违反相关法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。