

华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 3 号

2021 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：2021 年 07 月 01 日至 2021 年 9 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 3 号
理财产品代码	211978700103
产品登记编码	Z7003921000255
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(平衡型)
杠杆水平	125.30%
产品起始日期	2021-04-01
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
2021-09-30	1.0223	1,249,227,655.00	1.0223	1,277,138,041.32	1.04%
2021-06-30	1.0118	1,249,227,655.00	1.0118	1,263,936,510.95	

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	0.23%	3.26%
2	同业存单	0.00%	9.77%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.46%
4	债券	0.00%	58.14%
5	非标准化债权类资产	3.92%	3.13%
6	权益类投资	0.00%	4.16%
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%	21.08%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	95.85%	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	现金及银行存款	现金及银行存款	52,188,383.93	3.26%
2	21 浦发银行 CD147	同业存单	50,783,810.07	3.17%
3	冀银租赁融资项目 TYJK-JYJZ-202108-2	非标准化债权类 资产	50,086,666.71	3.13%
4	21 兴业银行 CD146	同业存单	28,764,856.22	1.80%
5	19 兴港 02	债券	26,382,957.46	1.65%
6	19 农发 07	债券	24,567,231.99	1.54%
7	富国信用债债券 A	公募基金	22,794,267.15	1.42%
8	21 浦发银行 CD138	同业存单	21,094,227.89	1.32%
9	21 光大控股 MTN001	债券	20,859,800.78	1.30%
10	20 民生银行二级	债券	20,690,459.37	1.29%

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	冀银金融租赁有限公司	冀银租赁融资项目 TYJK-JYJZ-202 108-2	同业借款	4.8	145	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	032100868.IB	21 吴兴城投 PPN002	878,468.52

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

本产品为定开型产品，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，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

本产品持有债券未出现信用评级下调及违约等信用风险事件，三季度在超预期降准下，流动性相对宽松，债券走出震荡上行行情，为产品净值提供正贡献，临近9月末，随通胀的抬升债券收益率有上行压力，波动加大。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品权益敞口三季度维持在9%中枢，大盘指数在9月上半月反弹后由于经济数据走弱，“拉闸限电”等调控以及个别信用风险事件的影响，9月下半月市场出现回跌，板块轮动加速，持仓波动加大，仍在可控范围。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000862391

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。