

华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 1 号

2021 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：2021 年 10 月 01 日至 2021 年 12 月 31 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 1 号
理财产品代码	211978700101
产品登记编码	Z7003921000231
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	114.07%
产品起始日期	2021-02-02
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
2021-12-31	1.0395	2,482,526,511.00	1.0395	2,580,702,785.07	2.34%
2021-09-30	1.0157	2,482,526,511.00	1.0157	2,521,615,053.24	

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	0.19%	6.09%
2	同业存单	0.00%	9.29%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.17%
4	债券	0.00%	37.03%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	4.40%
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%	43.02%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.81%	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	现金及活期存款	现金及银行存款	179,233,085.78	6.09%
2	广发聚鑫债券 A	公募基金	176,306,075.33	5.99%
3	21 光大银行 CD191	同业存单	110,658,830.63	3.76%
4	广发纯债债券 A	公募基金	93,310,583.12	3.17%
5	21 交通银行 CD298	同业存单	73,780,095.20	2.51%
6	21 建设银行 CD225	同业存单	73,778,968.73	2.51%
7	广发招享混合	公募基金	62,163,976.88	2.11%
8	广发集丰债券 A	公募基金	59,099,327.54	2.01%
9	20 华泰 G8	债券	57,206,360.76	1.94%
10	温氏转债	债券	40,035,311.55	1.36%

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
-	-	-	-	-	-	-

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）
-	-	-	-

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，四季度在“二次降准”下，流动性相对宽松，债券价格走出震荡上行行情，为产品净值提供正贡献。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品权益敞口四季度维持在 20% 中枢，其中，成长板块占比相对较高，在高景气赛道占优行情下，产品净值上行幅度大，在 12 月中旬后，新能源板块开始回调，产品波动较大。

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	10257000000857880

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。