

# 华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 4 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 4 号
理财产品代码	211978700104
产品登记编码	Z7003921000256
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	106.35%
产品起始日期	2021-04-13
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	1.0344	357,505,218.00	1.0344	369,796,779.72	1.37%
2021-09-30	1.0204	357,505,218.00	1.0204	364,801,489.93	

## 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	0.74%	7.04%
2	同业存单	0.00%	1.94%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.55%
4	债券	0.00%	54.57%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	5.52%
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%	30.37%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.26%	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	27,695,697.35	7.04%
2	富国信用债债券 A	公募基金	11,882,404.28	3.02%
3	富国泓利纯债债券型发起式 A	公募基金	10,636,891.53	2.70%
4	上银优 1	权益类投资	7,274,595.50	1.85%
5	富国天利增长债券	公募基金	7,216,191.04	1.83%
6	20 光穗首创 ABN001 优先	债券	6,051,841.07	1.54%
7	20 易睿平安 ABN001 优先	债券	6,002,439.62	1.53%
8	富国产业债债券 A	公募基金	5,154,892.96	1.31%
9	20 天成租赁 GN003	债券	5,062,150.07	1.29%
10	21 山东国惠 MTN001	债券	4,192,491.12	1.07%

### 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）
华夏银行股份有限公司	012103847.IB	21 云能投 SCP012	510,663.74
华夏银行股份有限公司	012104128.IB	21 陕西交通 SCP002	113,468.74
华夏银行股份有限公司	032191368.IB	21 青岛财富 PPN001	1,077,626.56

#### 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，12月的二次降准，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14%中枢，其中成长板块占比较高，在高景气赛道行情占优情况下，持仓部分对产品提供正贡献，12月中旬以来有所调整，产品波动加大。

#### 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	10257000000863190

## 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。