

# 华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 1 号

## 2022 年第 1 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 01 月 01 日至 2022 年 3 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 级（中等风险）
杠杆水平	107.88%
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
2022-03-31	1.0267	446,237,877.18	1.0267	458,171,226.37	-1.23%
2021-12-31	1.0395	2,482,526,511.00	1.0395	2,580,702,785.07	

## 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	0.93%	4.55%
2	同业存单	0.00%	3.72%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.97%
4	债券	0.00%	69.17%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	1.50%
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%	19.08%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.07%	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	22,473,084.49	4.55%
2	20 首创集 MTN002	债券	10,692,152.01	2.16%
3	21 厦门银行 CD255	同业存单	10,212,350.54	2.07%
4	买入返售金融资产	拆放同业及债券 买入返售	9,734,836.57	1.97%
5	20 金融街 MTN001A	债券	8,578,079.57	1.74%
6	富国泓利纯债 A	公募基金	8,342,266.51	1.69%
7	22 农业银行永续债 01	债券	8,285,738.37	1.68%
8	22 首集租	债券	8,267,636.39	1.67%
9	富国信用债债券 A	公募基金	6,737,032.50	1.36%
10	22 上饶国资专项债 01	债券	6,533,368.44	1.32%

### 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	102280693.IB	22 临平城建 MTN001	2,081,067.84

#### 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，持有的债券型基金无信用风险事件发生，一季度在宽货币与宽信用的博弈环境中走出震荡行情。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品在一月份定期开放，在进入新的封闭期后，逐步建仓至 10%，板块配置相对均衡，在 3 月份风险事件频发，权益市场出现一波急跌，在金稳委发声后市场有所恢复，产品净值出现小幅回撤。

#### 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。