

华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 3 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 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 级（中等风险）
杠杆水平	109.63%
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
2022-03-31	1.0157	1,249,227,655.00	1.0157	1,268,799,540.89	-2.10%
2021-12-31	1.0375	1,249,227,655.00	1.0375	1,296,022,642.09	

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	31.06%	28.74%
2	同业存单	0.00%	2.72%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.93%
4	债券	0.00%	61.53%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.51%
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	0.98%	4.57%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	67.95%	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	399,774,342.32	28.74%
2	买入返售金融资产	拆放同业及债券 买入返售	26,834,157.41	1.93%
3	22 首集租	债券	18,305,040.00	1.32%
4	20 首创集 MTN002	债券	18,294,725.40	1.32%
5	21 厦门银行 CD255	同业存单	17,473,764.75	1.26%
6	20 金融街 MTN001A	债券	14,677,457.83	1.06%
7	22 农业银行永续债 01	债券	14,177,249.64	1.02%
8	22 上饶国资专项债 01	债券	11,178,870.39	0.80%
9	环球 02A1	债券	11,143,929.43	0.80%
10	17 河钢集 MTN007	债券	10,900,498.66	0.78%

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	032280174.IB	22 中山火炬 PPN001	1,110,689.25
华夏银行股份有限公司	102280693.IB	22 临平城建 MTN001	3,560,795.31

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

本产品持有的权益资产主要为混合及权益型公募基金，在年初以来权益市场出现较大回撤，尤其是成长板块，3月份又受外部事件冲击，继续回调。本产品权益仓位在15%附近，产品净值出现回撤。

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	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。