

华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 1 号

2021 年第 2 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 04 月 01 日至 2021 年 6 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 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	110.20%
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
2021-06-30	1.0173	2,482,526,511.00	1.0173	2,525,579,431.56	2.08%
2021-03-31	0.9966	2,482,526,511.00	0.9966	2,474,079,069.25	

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	4.05%	11.40%
2	同业存单	0.00%	2.78%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.52%
4	债券	0.00%	39.17%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	4.72%
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%	40.41%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	95.95%	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	196,667,393.71	7.07%
2	广发聚鑫债券 A	公募基金	121,153,055.63	4.35%
3	广发景明中短债 A	公募基金	100,861,622.63	3.62%
4	21 交通银行 CD087	同业存单	77,320,994.85	2.78%
5	工商银行	现金及银行存款	76,241,667.12	2.74%
6	19 交通银行 02	债券	72,714,233.20	2.61%
7	广发纯债债券 A	公募基金	64,221,847.30	2.31%
8	GC007	拆放同业及债券 买入返售	42,398,857.20	1.52%
9	银华交易型货币 A	公募基金	41,924,752.26	1.51%
10	广发集丰债券 A	公募基金	41,333,214.71	1.49%

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	102101226.IB	21 义乌国资 MTN004	813,901.09

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,合理配置货币类、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，二季度市场流动性仍相对宽松背景下，债券收益率小幅下行，价格震荡上扬。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的股票仓位维持在 15% 中枢，相对保守，上证指数呈现震荡上行走势，持仓股票贡献正收益，波动情况在可控范围内。

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。