

华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 4 号

2022 年半年度报告

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 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 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 级（中等风险）
杠杆水平	107.59%
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
2022-06-30	1.0244	39,071,415.75	1.0244	40,025,304.00	-0.97%
2021-12-31	1.0344	357,505,218.00	1.0344	369,796,779.72	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*100%

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	6.26%	8.49%
2	同业存单	0.00%	2.36%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	58.95%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	3.25%
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	9.77%	26.95%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	83.97%	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	3,654,743.66	8.49%
2	景顺长城景颐双利 A	公募基金	1,512,420.38	3.51%
3	华泰柏瑞富利 A	公募基金	1,087,122.34	2.52%
4	华泰柏瑞中证光伏产业 ETF 联接 C	公募基金	960,387.73	2.23%
5	富国泓利纯债 A	公募基金	663,250.62	1.54%
6	22 国开 05	债券	571,238.11	1.33%
7	22 飞驰强链 ABN001 优先	债券	571,118.82	1.33%
8	21 厦门银行 CD255	同业存单	563,704.07	1.31%
9	22 河北银行永续债	债券	558,772.86	1.30%
10	20 金融街 MTN001A	债券	474,902.03	1.10%

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	012281600.IB	22 盐城国投 SCP002	77,048.97
华夏银行股份有限公司	032280058.IB	22 杭州农副 PPN001	92,226.62
华夏银行股份有限公司	102280061.IB	22 湘高速 MTN001	230,566.55
华夏银行股份有限公司	102280104.IB	22 宜春创业 MTN001	41,547.69
华夏银行股份有限公司	102280116.IB	22 新郑投资 MTN001	31,978.48
华夏银行股份有限公司	102280560.IB	22 郑州地产 MTN001	71,736.67
华夏银行股份有限公司	102280606.IB	22 京国资 MTN001	35,771.43
华夏银行股份有限公司	102280693.IB	22 临平城建 MTN001	213,658.45

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，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

上半年，国内经济受到内外部冲击影响下，增长压力较大，货币政策维持宽松，宏观环境整体对债市有利，而且在“资产荒”逻辑下，短久期资产受到大量资金青睐，利率下行较快，尽管6月份上海复产复工后，经济整体呈现复苏，但恢复速度缓慢，利率有缓慢回升，8月份超预期降息，利率继续下行。整体看，持仓债券价格上涨。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

一季度，赛道板块出现较大调整，产品在4月13日开放，在进入新的封闭期后，逐步均衡建仓，4月底双创指数快速下跌，稳增长板块也出现补跌，市场情绪宣泄式大幅下挫之后，高层喊话维稳市场，政治局会议对市场关切问题进行回应，夯实了政策底，5月和6月市场回暖，成长板块快速上涨。

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。

第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品
在投资运作过程中存在违反法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。