

# 华夏理财 ESG 混合偏债型一年定开理财产品 1 号

## 2022 年第 3 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 07 月 01 日至 2022 年 09 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 级（中等风险）                |
| 杠杆水平    | 110.00%                    |
| 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<br>(元) | 份额总数(份)        | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)        | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0427      | 446,237,877.18 | 1.0427      | 465,295,497.18 | -0.49%        |
| 2022-06-30 | 1.0478      | 446,237,877.18 | 1.0478      | 467,551,210.60 |               |

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       | 0.95%     | 3.16%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.07%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 1.21%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 72.11%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 3.10%     |
| 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          | 3.20%     | 20.35%    |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 95.86%    | 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|-----------------------|-----------------|---------------|-------------|
| 1  | 现金及银行存款               | 现金及银行存款         | 16,180,446.76 | 3.16%       |
| 2  | 富国中债 7-10 年政策性金融债 ETF | 公募基金            | 7,370,216.49  | 1.44%       |
| 3  | 永赢稳益债券                | 公募基金            | 7,251,904.97  | 1.42%       |
| 4  | 富国泓利纯债 A              | 公募基金            | 6,693,629.86  | 1.31%       |
| 5  | 债券买入返售                | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 6,175,109.72  | 1.21%       |
| 6  | 22 飞驰强链 ABN001 优先     | 债券              | 5,930,197.00  | 1.16%       |
| 7  | 22 海宁 03              | 债券              | 5,810,413.75  | 1.14%       |
| 8  | 富国天利增长债券              | 公募基金            | 5,432,751.02  | 1.06%       |
| 9  | 19 信投 01              | 债券              | 5,366,384.15  | 1.05%       |
| 10 | 交银裕隆纯债债券 A            | 公募基金            | 5,362,365.11  | 1.05%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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）    |
|-------------------|--------------|-----------------|------------|
| 北京科技园建设（集团）股份有限公司 | 032200226.IB | 22 京科技园 PPN001A | 618,652.30 |
| 鲁能集团有限公司          | 137819.SH    | 22 鲁能 02        | 572,633.90 |

#### 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 | 042280372.IB | 22 武清国资 CP004 | 556,293.95 |

#### 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

本产品持有的债券及债券型基金总体信用风险可控。三季度，经济基本面修复仍然面临众多挑战，货币政策维持宽松态势，并在 8 月中旬下调 OMO 利率，推动十年国债收益率下行。但随着降息带来的做多情绪逐步弱化，叠加稳增长政策加码，9 月初以来债市以回调为主。总体来讲，本季度市场利率走势呈先下后上的形态。信用债方面，违约依然集中在民营房地产主体，违约率处于近两年高位。报告期内，产品持仓债券整体上涨。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品未直接持有股票，主要通过权益或混合类公募基金参与权益市场的投资。三季度，海内外不确定性交织共振，海外方面，美国通胀率超预期，联储加息态度强硬，人民币汇率承压；国内方面，疫情呈现多点散发式布局，打乱经济修复节奏，7 月份房地产市场发生“断供”风波，地产下行压力凸显。在此背景下，权益市场呈现震荡下行走势，且回调幅度较大。本产品对持仓结构进行了调整，择机降低权益仓位，控制产品净值回撤幅度。

#### 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。