

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 45号

2024年第1季度报告

重要信息提示：

- 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。
- 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：2024年1月1日至2024年3月31日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 45 号
理财产品代码	22121045
M 份额销售代码	22121045M
N 份额销售代码	22121045N
产品登记编码	Z7003922000153
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式
产品投资性质	固定收益类
投资及收益币种	人民币
产品风险评级	PR2 级（中低风险）
杠杆水平	102.96%
产品起始日期	2023-03-16
产品终止日期	2024-05-14

注：由于子份额可能存在募集金额或存续金额为 0，导致无持有人的情形，本报告仅列示报告期末存续金额不为 0 的相关子份额信息。

第二章 净值、存续规模及收益表现

M 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数(份)	累计净值 (元)	资产净值(元)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0426	798,196,428.00	1.0426	832,188,817.14	0.90%
2023-12-31	1.0333	798,196,428.00	1.0333	824,744,221.27	

N 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数(份)	累计净值 (元)	资产净值(元)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0435	139,958,043.00	1.0435	146,051,310.90	0.92%
2023-12-31	1.0340	139,958,043.00	1.0340	144,717,714.07	

注：期间净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值*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	0.02%	24.54%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	52.60%
5	非标准化债权类资产	23.46%	22.86%
6	权益类投资	0.00%	0.00%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	76.51%	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；“权益类投资”类别中包含优先股。

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	中铁信托.绍兴市柯桥区中心城建设 投资开发有限公司(第一期)2.3亿 0513到期	非标准化债权类 资产	230,298,329.72	22.86%
2	23 上饶城投 PPN001	债券	39,992,835.97	3.97%
3	23 中德集团 PPN001	债券	39,576,445.25	3.93%
4	21 甘公投 PPN001	债券	33,321,884.62	3.31%
5	21 济金 02	债券	33,216,904.19	3.30%
6	22 新余 02	债券	33,160,048.77	3.29%
7	23 枫桥 02	债券	32,689,421.97	3.25%
8	建行张家界桑植支行 20230824-15	现金及银行存款	32,224,574.04	3.20%
9	建行邵阳城南支行 20230824-15	现金及银行存款	32,224,574.04	3.20%
10	21 桂交 01	债券	30,192,383.59	3.00%

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
1	绍兴市柯桥区中心城建设投资开发有限公司	中铁信托.绍兴市柯桥区中心城建设投资开发有限公司(第一期)2.3亿0513到期	信托贷款	4.3418	43	正常

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	投资规模（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	投资规模（元）
-	-	-	-

3.4.3 报告期内其他关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	投资规模（元）
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托-嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	80,000,000.00

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份理财份额分红数（元）
-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

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

截至本报告日，产品投资的债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

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	10250000003353162

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。