

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 107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 107 号
理财产品代码	23121107
产品登记编码	Z7003923000140
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	114.68%
产品起始日期	2023-06-01
产品终止日期	2024-07-03

## 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0387	447,918,294.00	1.0387	465,259,850.05	1.15%
2023-12-31	1.0269	447,918,294.00	1.0269	459,965,768.09	

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	0.04%	5.80%
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%	56.67%
5	非标准化债权类资产	42.84%	37.53%
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	57.12%	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	华鑫信托.江苏开晟产业发展集团有限公司理财融资项目.建业 80 号	非标准化债权类 资产	150,171,119.10	28.14%
2	渤海信托.重庆空港新城开发建设有 限公司理财融资项目第一期(106 号 /107 号/78 号/27 号)	非标准化债权类 资产	50,055,323.42	9.38%
3	23 海资 03	债券	13,941,405.42	2.61%
4	中行苏州高新技术产业开发区支行 20231026-40	现金及银行存款	11,976,019.75	2.24%
5	22 新海连 MTN002	债券	11,305,972.50	2.12%
6	22 首股 02	债券	8,324,857.24	1.56%
7	23 科城 Y2	债券	8,258,706.02	1.55%
8	23 黄发 02	债券	7,190,914.82	1.35%
9	23 信达地产 PPN001	债券	7,179,091.71	1.35%
10	22 金阳投资 PPN001	债券	7,131,113.67	1.34%

### 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	江苏开晟产业发展集团有限公司	华鑫信托.江苏开晟产业发展集团有限公司理财融资项目. 建业 80 号	信托贷款	4.7722	93	正常
2	重庆空港新城开发建设有限公司	渤海信托.重庆空港新城开发建设有限公司理财融资项目第一期 (106 号/107 号/78 号/27 号)	信托贷款	4.6500	92	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	ZC1A2W OTC	中诚信托-汇鑫 14 号 集合资金信托计划	买入	26,500,000.00

## 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	10250000003369092

## 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。