

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 109 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 109 号
理财产品代码	23121109
产品登记编码	Z7003923000141
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	128.21%
产品起始日期	2023-06-20
产品终止日期	2024-07-10

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	1.0370	137,121,179.00	1.0370	142,188,060.19	1.19%
2023-12-31	1.0248	137,121,179.00	1.0248	140,525,201.16	

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	0.11%	0.33%
2	同业存单	0.00%	1.31%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.24%
4	债券	0.00%	64.62%
5	非标准化债权类资产	42.70%	33.50%
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	57.19%	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	渤海信托.成都市金牛国投城市运营管理有限公司理财融资项目.2023金雀 165 号	非标准化债权类资产	61,073,136.52	33.50%
2	20 株国 06	债券	4,987,170.67	2.74%
3	21 电建 01	债券	3,754,826.81	2.06%
4	23 安租 Y4	债券	2,456,159.06	1.35%
5	23 中国银行 CD032	同业存单	2,386,686.95	1.31%
6	23 赣州发展 MTN002	债券	2,218,440.42	1.22%
7	23 青租 03	债券	2,215,130.62	1.22%
8	21 北建 01	债券	2,209,282.93	1.21%
9	23 西安高新 PPN002	债券	2,014,123.23	1.10%
10	22 首城 01	债券	1,996,127.58	1.09%

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	成都市金牛国投城市运营管理有限公司	渤海信托.成都市金牛国投城市运营管理有限公司理财融资项目.2023金雀 165 号	信托贷款	4.9200	89	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）
-	-	-	-	-

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

本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,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前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

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,整体波动率在合理区间范围内。

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	10250000003371986

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。