

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 142 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 142 号
理财产品代码	23121142
A 份额销售代码	23121142A
B 份额销售代码	23121142B
X 份额销售代码	23121142X
产品登记编码	Z7003923000258
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	127.52%
产品起始日期	2023-07-26
产品终止日期	2024-08-27

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

A 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	1.0305	779,064,576.00	1.0305	802,797,154.98	1.14%
2023-12-31	1.0189	779,064,576.00	1.0189	793,758,115.25	

B 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	1.0294	93,576,826.00	1.0294	96,332,091.37	1.10%
2023-12-31	1.0182	93,576,826.00	1.0182	95,277,256.21	

X 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	1.0312	127,218,211.00	1.0312	131,182,265.71	1.17%
2023-12-31	1.0193	127,218,211.00	1.0193	129,669,710.15	

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	0.03%	0.59%
2	同业存单	0.00%	1.28%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.23%
4	债券	0.00%	63.69%
5	非标准化债权类资产	43.38%	34.21%
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	56.59%	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.象山县滨海投资有限公司. 鑫悦 157 号.债权封闭 142 号	非标准化债权类 资产	249,218,930.64	18.97%
2	渤海信托.北塘湾(天津)科技发展 有限公司理财融资项目(第五 期).2023 盈夏 9 号.债权 142 号	非标准化债权类 资产	150,169,627.23	11.43%
3	渤海信托.株洲新芦淞航空城产业发 展.2023 安泰 32.债权封闭 142.150. 臻享私募 36	非标准化债权类 资产	50,068,599.12	3.81%
4	20 株国 06	债券	35,146,291.16	2.68%
5	21 电建 01	债券	26,461,544.02	2.01%
6	23 安租 Y4	债券	17,309,389.89	1.32%
7	23 中国银行 CD032	同业存单	16,819,796.21	1.28%
8	23 青租 03	债券	16,042,542.02	1.22%
9	23 赣州发展 MTN002	债券	15,634,105.59	1.19%
10	21 北建 01	债券	15,569,569.61	1.19%

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	象山县滨海投资有限公司	华鑫信托.象山县滨海投资有限公司.鑫悦 157 号.债权封闭 142 号	信托贷款	4.5190	148	正常
2	北塘湾(天津)科技发展有限公司	渤海信托.北塘湾(天津)科技发展有限公司理财融资项目(第五期).2023 盈夏 9 号.债权 142 号	信托贷款	5.3100	145	正常
3	株洲新芦淞航空城产业发展有限公司	渤海信托.株洲新芦淞航空城产业发展.2023 安泰 32.债权封闭 142.150.臻享私募 36	信托贷款	5.9880	135	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

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	10250000003377693

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。