

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 157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 157 号
理财产品代码	23121157
产品登记编码	Z7003923000250
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	122.26%
产品起始日期	2023-09-08
产品终止日期	2024-10-09

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	1.0255	1,233,303,423.00	1.0255	1,264,786,537.75	1.14%
2023-12-31	1.0139	1,233,303,423.00	1.0139	1,250,447,346.80	

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%	4.61%
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%	59.78%
5	非标准化债权类资产	43.30%	35.60%
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	56.67%	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	中信信托·德清县建设发展集团有限公司·华信 33 号·债权封闭 157 号	非标准化债权类 资产	400,316,291.85	25.89%
2	山东信托·洛阳国晟·融华 16 号·债权 封闭 171 号·167 号·157 号	非标准化债权类 资产	150,211,271.64	9.71%
3	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	71,351,856.00	4.61%
4	20 济宁城投永续期债	债券	28,443,414.52	1.84%
5	22 宣城经开 PPN001	债券	25,492,685.27	1.65%
6	湘江 22Y	债券	21,447,767.74	1.39%
7	23 青租 03	债券	21,432,818.52	1.39%
8	23 中交 01	债券	21,042,725.00	1.36%
9	23 华侨城 MTN003A	债券	19,514,273.61	1.26%
10	23 科城 Y2	债券	19,345,961.42	1.25%

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	德清县建设发展集团有限公司	中信信托.德清县建设发展集团有限公司.华信 33 号.债权封闭 157 号	信托贷款	4.3065	191	正常
2	洛阳国晟投资控股集团有限公司	山东信托.洛阳国晟.融华 16 号.债权封闭 171 号.167 号.157 号	信托贷款	5.0576	191	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）
首创证券股份有限公司	143930	庐陵二 3A	4,692,428.17

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	1025700000943043

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。