

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 177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 177 号 |
| 理财产品代码   | 23121177                 |
| A 份额销售代码 | 23121177A                |
| B 份额销售代码 | 23121177B                |
| V 份额销售代码 | 23121177V                |
| Z 份额销售代码 | 23121177Z                |
| 产品登记编码   | Z7003923000352           |
| 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     | 127.94%                  |
| 产品起始日期   | 2023-10-18               |
| 产品终止日期   | 2024-11-19               |

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<br>(元) | 份额总数(份)          | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)          | 期间净值增<br>长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|-------------|
| 2024-03-31 | 1.0217      | 1,364,606,099.00 | 1.0217      | 1,394,202,230.60 | 1.18%       |
| 2023-12-31 | 1.0098      | 1,364,606,099.00 | 1.0098      | 1,377,951,806.62 |             |

### B 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数(份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)       | 期间净值增<br>长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-------------|
| 2024-03-31 | 1.0205      | 52,180,000.00 | 1.0205      | 53,250,539.44 | 1.11%       |
| 2023-12-31 | 1.0093      | 52,180,000.00 | 1.0093      | 52,663,237.61 |             |

### V 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数(份)        | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)        | 期间净值增<br>长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|-------------|
| 2024-03-31 | 1.0214      | 136,645,279.00 | 1.0214      | 139,575,497.04 | 1.16%       |
| 2023-12-31 | 1.0097      | 136,645,279.00 | 1.0097      | 137,967,480.02 |             |

### Z 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数(份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)       | 期间净值增<br>长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-------------|
| 2024-03-31 | 1.0210      | 62,256,206.00 | 1.0210      | 63,563,897.50 | 1.14%       |
| 2023-12-31 | 1.0095      | 62,256,206.00 | 1.0095      | 62,845,680.43 |             |

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       | 0.01%     | 0.77%     |
| 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%     | 64.21%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 43.62%    | 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%     | 0.81%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 56.37%    | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|---|-----------|----------------|-------------|
| 1  | 杭工信托.台州市路桥区社会事业发展集团.尊利 2 号.臻享 39 号.债权封闭 177 号 | 非标准化债权类资产 | 446,269,543.95 | 21.13%      |
| 2  | 西部信托.南京江宁(大学)科教创新园有限公司.稳鑫 10 号.债权封闭 177 号     | 非标准化债权类资产 | 250,136,065.93 | 11.85%      |
| 3  | 青租 20 优                                       | 债券        | 34,928,002.80  | 1.65%       |
| 4  | 20 民生银行二级                                     | 债券        | 32,907,258.96  | 1.56%       |
| 5  | 23 安租 10                                      | 债券        | 26,187,840.57  | 1.24%       |
| 6  | 21 晋煤 Y1                                      | 债券        | 25,333,580.24  | 1.20%       |
| 7  | 中信信托.盐城市城市资产投资集团.华信 21 号.债权封闭 177 号           | 非标准化债权类资产 | 25,033,512.00  | 1.19%       |
| 8  | 22 首股 02                                      | 债券        | 19,635,740.02  | 0.93%       |
| 9  | 22 汉口银行二级 01                                  | 债券        | 17,179,213.82  | 0.81%       |
| 10 | 23 国药租赁 MTN001                                | 债券        | 16,218,568.03  | 0.77%       |

### 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  | 台州市路桥区社会事业发展集团有限公司 | 杭工信托.台州市路桥区社会事业发展集团.尊利2号.臻享39号.债权封闭177号  | 信托贷款 | 4.5368  | 232      | 正常   |
| 2  | 南京江宁(大学)科教创新园有限公司  | 西部信托.南京江宁(大学)科教创新园有限公司.稳鑫10号.债权封闭177号    | 信托贷款 | 4.3400  | 232      | 正常   |
| 3  | 盐城市城市资产投资集团有限公司    | 中信信托.盐城市城市资产投资集团.华信21号.债权封闭177号          | 信托贷款 | 5.3975  | 232      | 正常   |
| 4  | 非特定消费信贷客户          | 中诚信托.腾讯分付信托承接池理财融资项目.瑞成16号.债权封闭190号.177号 | 信托贷款 | 4.6000  | 208      | 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 | 5,349,931.06 |

#### 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、债券类及非标类资产,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

本产品持仓债券未出现信用违约等信用风险事件,2024年1季度债券收益率以下行为主,组合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 | 10257000000945109 |

## 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。