

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 192 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 192 号
理财产品代码	23121192
A 份额销售代码	23121192A
B 份额销售代码	23121192B
产品登记编码	Z7003923000382
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	100.09%
产品起始日期	2023-11-01
产品终止日期	2025-11-18

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	1.0142	69,622,934.00	1.0142	70,608,769.10	0.93%
2023-12-31	1.0049	69,622,934.00	1.0049	69,961,662.55	

### 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	1.0133	600,000.00	1.0133	607,993.34	0.88%
2023-12-31	1.0045	600,000.00	1.0045	602,720.90	

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	0.98%	1.58%
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%	54.22%
5	非标准化债权类资产	44.21%	44.20%
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	54.81%	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.同安控股有限责任公司.华 信 13.债权封闭 191.192 号	非标准化债权类 资产	31,510,293.13	44.20%
2	22 光明房产 MTN002	债券	5,985,529.26	8.40%
3	23 西安高新 PPN003	债券	5,828,634.89	8.18%
4	23 六合交通 MTN002	债券	5,800,110.85	8.14%
5	22 瓯江 01	债券	5,799,822.84	8.14%
6	22 南浔 01	债券	5,790,257.29	8.12%
7	22 汴投 02	债券	5,772,184.90	8.10%
8	22 株国投 MTN002	债券	3,671,601.34	5.15%
9	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,124,505.85	1.58%
10	-	-	-	-

### 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	同安控股有限责任公司	中信信托.同安控股有限责任公司.华信 13.债权封闭 191.192号	信托贷款	4.6360	593	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

本产品为摊余成本法计价的封闭式理财产品，流动性风险控制方面，本产品在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，并根据产品的期限，合理安排各类资产久期，预防流动性风险。

### 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，产品持仓债券整体波动率表现符合摊余成本法资产计价特征。

#### 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	1025700000948814

## 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。