

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 203 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：中国民生银行股份有限公司

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 203 号
理财产品代码	23121203
M 份额销售代码	23121203M
N 份额销售代码	23121203N
产品登记编码	Z7003923000431
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	125.81%
产品起始日期	2023-10-17
产品终止日期	2024-11-26

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

M 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	1.0160	256,036,114.00	1.0160	260,124,397.54	0.91%
2023-12-31	1.0068	256,036,114.00	1.0068	257,764,820.91	

N 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	1.0162	276,068,149.00	1.0162	280,530,149.10	0.92%
2023-12-31	1.0069	276,068,149.00	1.0069	277,960,661.94	

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	0.73%	1.01%
2	同业存单	0.00%	0.63%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	71.99%
5	非标准化债权类资产	24.04%	19.13%
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%	7.24%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	75.23%	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·嵊州市交通投资发展集团有限公司·华信 29 号·债权 205 号·债权 203 号	非标准化债权类 资产	130,098,972.75	19.13%
2	21 胶州湾 PPN003	债券	26,568,629.99	3.91%
3	19 新昌 01	债券	24,615,404.94	3.62%
4	21 中证融担 PPN001	债券	24,524,518.55	3.61%
5	21 涪新 03	债券	24,323,612.35	3.58%
6	21 拱墅 03	债券	24,243,833.27	3.56%
7	21 中兴产投 PPN001	债券	23,873,200.34	3.51%
8	21 东龙控股 PPN002	债券	22,350,494.57	3.29%
9	19 淮建 01	债券	20,857,976.53	3.07%
10	21 龙口城乡 PPN002	债券	20,081,329.59	2.95%

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	嵊州市交通投资发展集团有限公司	中信信托.嵊州市交通投资发展集团有限公司.华信 29 号.债权 205 号.债权 203 号	信托贷款	4.6300	232	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）
平安银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	2,980,153.39

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

本产品报告期内未开放，具有足够的高流动性资产应对临时赎回。

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

本产品持有中高等级信用债及精选债券基金，本报告期内估值在正常范围波动。持有非标资产估值稳定，信用风险可控。

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	641906303

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。