

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 206 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 206 号
理财产品代码	23121206
产品登记编码	Z7003923000424
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	113.01%
产品起始日期	2023-10-17
产品终止日期	2024-07-17

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	1.0150	286,740,454.00	1.0150	291,034,187.42	0.82%
2023-12-31	1.0067	286,740,454.00	1.0067	288,648,794.59	

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	0.08%	31.34%
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%	50.20%
5	非标准化债权类资产	18.91%	16.75%
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%	1.71%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	81.01%	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·中国平煤神马控股集团·华信 45·增强封闭 50 号·债权封闭 206 号·百岁 G 款 9 号	非标准化债权类资产	55,074,179.91	16.75%
2	农业银行无锡惠山支行 202403194043	现金及银行存款	14,290,837.42	4.35%
3	农业银行无锡锡山支行 202403197715	现金及银行存款	14,290,837.42	4.35%
4	农业银行射阳县支行 202403228359	现金及银行存款	14,287,492.71	4.34%
5	农业银行丹阳埤城支行 202403193829	现金及银行存款	7,145,418.71	2.17%
6	农业银行扬中市支行 202403194095	现金及银行存款	7,145,418.71	2.17%
7	农业银行宝应县支行 202403221967	现金及银行存款	7,143,746.36	2.17%
8	农业银行高邮市支行 202403229703	现金及银行存款	7,143,746.36	2.17%
9	工商银行义乌港城支行 202403273857	现金及银行存款	7,143,244.17	2.17%
10	工商银行义乌港城支行 202403273858	现金及银行存款	7,143,244.17	2.17%

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	中国平煤神马控股集团有限公司	中信信托.中国平煤神马控股集团.华信 45.增强封闭 50 号.债权封闭 206 号.百岁 G 款 9 号	信托贷款	4.6800	106	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	767,644.07

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）
中诚信托有 限责任公司	ZC1A2W OTC	中诚信托-汇鑫 14 号 集合资金信托计划	买入	133,000,000.00

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	10257000000948202

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。