

华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财 产品 37 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	华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财产品 37 号
理财产品代码	23151037
A 份额销售代码	23151037A
B 份额销售代码	23151037B
C 份额销售代码	23151037C
产品登记编码	Z7003923000287
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	103.89%
产品起始日期	2023-09-14
产品终止日期	2024-10-22

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	1.0258	164,383,342.00	1.0258	168,621,506.96	1.16%
2023-12-31	1.0140	164,383,342.00	1.0140	166,686,487.19	

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	1.0244	4,859,500.00	1.0244	4,978,068.95	1.11%
2023-12-31	1.0132	4,859,500.00	1.0132	4,923,824.08	

C 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	1.0249	18,539,334.00	1.0249	19,001,563.82	1.12%
2023-12-31	1.0135	18,539,334.00	1.0135	18,790,289.45	

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	2.18%	2.27%
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	5.84%	55.63%
5	非标准化债权类资产	43.45%	42.01%
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%	0.09%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	48.52%	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	渤海信托.西部(重庆)科学城江津 园区开发建设集团.2023 盈夏 2 号. 精选 37 号.债权 173 号	非标准化债权类 资产	84,058,532.54	42.01%
2	19 绵投 01	债券	11,305,246.18	5.65%
3	22 华远 01	债券	8,341,328.48	4.17%
4	22 蛇口 02	债券	7,393,663.60	3.69%
5	21 狮产 01	债券	5,547,923.40	2.77%
6	19 金水 02	债券	4,896,924.26	2.45%
7	20 网商银行永续债 01	债券	4,586,484.14	2.29%
8	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	4,542,827.31	2.27%
9	21 动投 01	债券	4,435,875.49	2.22%
10	G23 濉溪	债券	3,707,249.09	1.85%

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	西部(重庆)科学城江津园区开发建设集团有限公司	渤海信托.西部(重庆)科学城江津园区开发建设集团.2023盈夏2号.精选37号.债权173号	信托贷款	4.4560	197	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

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控；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可能出现的流动性风险。

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，产品投资的债券资产总体资质较优。产品组合久期控制在合理范围内，债券资产价格波动对组合净值影响保持在可控范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本无权益类资产持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品仓位

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000945369

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。