

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 105 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 105 号
理财产品代码	23121105
A 份额销售代码	23121105A
B 份额销售代码	23121105B
产品登记编码	Z7003923000138
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	115.88%
产品起始日期	2023-05-24
产品终止日期	2024-06-25

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	1.0381	189,454,951.00	1.0381	196,670,235.21	1.12%
2023-12-31	1.0266	189,454,951.00	1.0266	194,499,051.61	

### 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	1.0372	40,997,176.00	1.0372	42,522,999.65	1.09%
2023-12-31	1.0260	40,997,176.00	1.0260	42,065,069.37	

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	0.28%	3.49%
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%	60.39%
5	非标准化债权类资产	41.62%	36.12%
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	58.10%	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.徐州经济技术开发区理财 融资项目.金雀 163.0625 到期	非标准化债权类 资产	70,067,583.70	25.28%
2	中信信托.泰州医药城控股集团有限 公司理财融资项目.华信 10 号	非标准化债权类 资产	30,045,971.67	10.84%
3	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	9,664,733.94	3.49%
4	23 海资 03	债券	7,717,961.93	2.78%
5	22 新海连 MTN002	债券	6,258,986.29	2.26%
6	22 首股 02	债券	4,608,640.90	1.66%
7	23 科城 Y2	债券	4,572,019.59	1.65%
8	23 黄发 02	债券	3,980,890.39	1.44%
9	23 信达地产 PPN001	债券	3,974,345.11	1.43%
10	22 金阳投资 PPN001	债券	3,947,784.47	1.42%

### 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	徐州经济技术开发区国有资产经营有限责任公司	渤海信托.徐州经济技术开发区理财融资项目.金雀 163.0625 到期	信托贷款	4.5352	86	正常
2	泰州医药城控股集团有限公司	中信信托.泰州医药城控股集团有限公司理财融资项目.华信 10 号	信托贷款	5.1139	86	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

本产品在对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	10250000003368044

## 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。