

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 128 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 128 号
理财产品代码	23121128
产品登记编码	Z7003923000189
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	101.67%
产品起始日期	2023-09-22
产品终止日期	2024-04-09

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	1.0188	1,401,266,866.00	1.0188	1,427,621,244.54	0.89%
2023-12-31	1.0098	1,401,266,866.00	1.0098	1,414,945,832.02	

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	0.39%	38.55%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.08%
4	债券	0.00%	26.87%
5	非标准化债权类资产	32.03%	31.52%
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%	2.99%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	67.58%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	487,091,063.81	33.56%
2	河南九鼎租赁同业借款.债权 128 号	非标准化债权类 资产	232,222,200.73	16.00%
3	渤海信托.徐州市新水国有资产经营 有限责任公司.2023 金雀 172 号.债权 封闭 128 号.第三期	非标准化债权类 资产	225,243,669.69	15.52%
4	24 保利发展 MTN003	债券	32,577,214.68	2.24%
5	汇添富长添利定期开放债券 A	公募基金	25,431,370.62	1.75%
6	农行天津滨海分行 20230906/12	现金及银行存款	25,318,338.82	1.74%
7	22 烟台财金 PPN001	债券	19,355,983.84	1.33%
8	农行北京门头沟支行 20230908/8	现金及银行存款	16,876,305.37	1.16%
9	20 民生银行二级	债券	15,426,373.51	1.06%
10	22 泰乡 01	债券	15,335,927.50	1.06%

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	河南九鼎金融租赁股份有限公司	河南九鼎租赁同业借款.债权128号	同业借款	3.2000	8	正常
2	徐州市新水国有资产经营有限责任公司	渤海信托.徐州市新水国有资产经营有限责任公司.2023金雀172号.债权封闭128号.第三期	信托贷款	3.6098	8	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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向非标资产及资产管理计划。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，做好流动性管理。

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

截止本报告日，本产品投资的债券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

截至本报告日，本产品无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000945427

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。