

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 137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 137 号
理财产品代码	23121137
A 份额销售代码	23121137A
B 份额销售代码	23121137B
X 份额销售代码	23121137X
产品登记编码	Z7003923000191
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	114.75%
产品起始日期	2023-07-12
产品终止日期	2024-08-13

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	1.0325	500,046,277.00	1.0325	516,302,627.26	1.12%
2023-12-31	1.0211	500,046,277.00	1.0211	510,601,062.21	

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	1.0314	44,193,844.00	1.0314	45,581,541.51	1.08%
2023-12-31	1.0204	44,193,844.00	1.0204	45,096,697.15	

X 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	1.0333	551,513,426.00	1.0333	569,860,434.42	1.15%
2023-12-31	1.0216	551,513,426.00	1.0216	563,440,855.11	

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	0.11%	24.00%
2	同业存单	0.00%	0.86%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.14%
4	债券	0.00%	37.06%
5	非标准化债权类资产	43.27%	37.94%
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%	0.01%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	56.63%	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	华鑫信托.义乌市建设投资集团有限公司.建业 95 号.债权封闭 137 号	非标准化债权类 资产	235,205,074.40	18.11%
2	中信信托.泰州医药城控股集团.华信 10.债权封闭 137 号	非标准化债权类 资产	100,143,625.26	7.71%
3	中信信托.青岛城投城金控股集团.华信 17.债权封闭 137 号	非标准化债权类 资产	100,129,465.40	7.71%
4	中信信托.泰州医药城控股集团.华信 10.债权封闭 137 号	非标准化债权类 资产	57,282,268.22	4.41%
5	农行台州温岭支行 20(20220610)	现金及银行存款	51,997,433.72	4.00%
6	工行中山银苑支行 9.9(20220728)	现金及银行存款	51,272,888.99	3.95%
7	农业银行逸景翠园支行 20 (20230324)	现金及银行存款	50,791,394.65	3.91%
8	工商银行佛山高明沧江支行 9.9(20220630)	现金及银行存款	25,696,110.86	1.98%
9	工行中山西区支行 9.8(20220722)	现金及银行存款	25,390,147.01	1.96%
10	工行中山城北支行 9.7(20220722)	现金及银行存款	25,131,063.88	1.94%

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	义乌市建设投资集团有限公司	华鑫信托.义乌市建设投资集团有限公司.建业 95 号.债权封闭 137 号	信托贷款	4.3434	134	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.华信 10.债权封闭 137 号	信托贷款	5.1139	135	正常
3	青岛城投城金控股集团有限公司	中信信托.青岛城投城金控股集团有限公司.华信 17.债权封闭 137 号	信托贷款	4.6830	134	正常
4	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.华信 10.债权封闭 137 号	信托贷款	5.1139	134	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

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	10250000003375709

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。