

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 156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 156 号 |
| 理财产品代码   | 23121156                 |
| M 份额销售代码 | 23121156M                |
| S 份额销售代码 | 23121156S                |
| 产品登记编码   | Z7003923000269           |
| 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     | 135.39%                  |
| 产品起始日期   | 2023-08-16               |
| 产品终止日期   | 2025-09-16               |

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

### M 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数(份)        | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)        | 期间净值增<br>长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|-------------|
| 2024-03-31 | 1.0348      | 274,112,789.00 | 1.0348      | 283,645,152.24 | 1.43%       |
| 2023-12-31 | 1.0202      | 274,112,789.00 | 1.0202      | 279,639,196.62 |             |

### S 份额：

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数(份)        | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)        | 期间净值增<br>长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|-------------|
| 2024-03-31 | 1.0353      | 115,000,000.00 | 1.0353      | 119,064,286.84 | 1.45%       |
| 2023-12-31 | 1.0205      | 115,000,000.00 | 1.0205      | 117,360,596.43 |             |

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       | 0.03%     | 0.24%     |
| 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%     | 81.96%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 23.83%    | 17.80%    |
| 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        | 76.14%    | 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|------------------------------|---------------|---------------|-------------|
| 1  | 华鑫信托.绍兴滨海新区发展集团有限公司.鑫苏 835 号 | 非标准化债权类<br>资产 | 97,027,646.90 | 17.80%      |
| 2  | 23 南新 02                     | 债券            | 25,100,129.01 | 4.60%       |
| 3  | 22 泰山投资 MTN002               | 债券            | 25,091,765.89 | 4.60%       |
| 4  | 23 鄂联投 MTN005                | 债券            | 25,089,006.98 | 4.60%       |
| 5  | 23 淄博城资 PPN002B              | 债券            | 25,083,699.37 | 4.60%       |
| 6  | 22 重庆物流 MTN002A              | 债券            | 25,062,206.16 | 4.60%       |
| 7  | 23 武汉旅游 MTN002               | 债券            | 25,002,127.62 | 4.59%       |
| 8  | 22 渤投 01                     | 债券            | 24,982,639.76 | 4.58%       |
| 9  | 22 首城 01                     | 债券            | 24,953,407.41 | 4.58%       |
| 10 | 23 科投 K4                     | 债券            | 24,896,022.97 | 4.57%       |

### 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  | 绍兴滨海新区发展集团有限公司 | 华鑫信托.绍兴滨海新区发展集团有限公司.鑫苏 835 号 | 信托贷款 | 4.9206 | 512     | 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,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

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,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 | 10257000000942936 |

## 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。