

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 207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 207 号
理财产品代码	23121207
A 份额销售代码	23121207A
H 份额销售代码	23121207H
X 份额销售代码	23121207X
产品登记编码	Z7003923000425
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	106.08%
产品起始日期	2023-11-01
产品终止日期	2024-05-07

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	1.0138	380,404,603.00	1.0138	385,660,446.85	1.07%
2023-12-31	1.0031	380,404,603.00	1.0031	381,595,449.38	

### H 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	1.0136	182,630,326.00	1.0136	185,115,401.64	1.06%
2023-12-31	1.0030	182,630,326.00	1.0030	183,186,988.99	

### 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	1.0142	36,927,073.00	1.0142	37,452,738.28	1.09%
2023-12-31	1.0033	36,927,073.00	1.0033	37,048,761.57	

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	0.41%	0.42%
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%	35.03%
5	非标准化债权类资产	44.42%	41.89%
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%	22.67%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	55.17%	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	民生金融租赁借款合同 151 天.债权 封闭 207 号	非标准化债权类 资产	270,268,752.52	41.89%
2	中银纯债债券 D	公募基金	34,026,679.92	5.27%
3	易方达投资级信用债债券 D	公募基金	34,022,916.11	5.27%
4	鹏华金利债券	公募基金	34,012,264.45	5.27%
5	华夏鼎茂债券 A	公募基金	34,008,147.22	5.27%
6	23 中粮置业 MTN001	债券	24,500,649.12	3.80%
7	23 福建漳州 MTN007B	债券	20,972,559.46	3.25%
8	23 中原银行永续债 01	债券	18,494,491.79	2.87%
9	21 东莞银行二级 02	债券	18,485,625.84	2.87%
10	21 广州银行二级	债券	18,221,379.01	2.82%

### 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	民生金融租赁股份有限公司	民生金融租赁借款合同 151 天.债权封闭 207 号	同业借款	3.5000	36	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。

### 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

本产品持仓信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生，价格波动可控。

#### 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	10257000000948767

## 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。