

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 209 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 209 号
理财产品代码	23121209
A 份额销售代码	23121209A
M 份额销售代码	23121209M
V 份额销售代码	23121209V
产品登记编码	Z7003923000427
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	116.02%
产品起始日期	2023-12-01
产品终止日期	2024-06-04

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	1.0107	1,224,840,127.00	1.0107	1,237,912,097.55	0.80%
2023-12-31	1.0027	1,224,840,127.00	1.0027	1,228,193,383.12	

M 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	1.0105	222,749,772.00	1.0105	225,089,811.64	0.78%
2023-12-31	1.0027	222,749,772.00	1.0027	223,350,417.92	

V 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	1.0103	82,500,000.00	1.0103	83,352,894.87	0.76%
2023-12-31	1.0027	82,500,000.00	1.0027	82,719,062.59	

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%	17.23%
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%	60.95%
5	非标准化债权类资产	23.29%	20.08%
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%	1.73%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	76.68%	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 180 天.债权 封闭 209 号	非标准化债权类 资产	360,337,798.73	20.08%
2	农行惠东县支行 20231123-30	现金及银行存款	161,583,586.89	9.01%
3	农行龙门县支行 20231124-10	现金及银行存款	53,856,629.08	3.00%
4	19 昆交 05	债券	21,166,143.55	1.18%
5	21 华侨城 MTN005	债券	19,617,224.24	1.09%
6	22 宿迁经开 PPN002	债券	17,377,223.64	0.97%
7	22 商城 01	债券	17,171,911.51	0.96%
8	22 西永 PPN001	债券	16,710,125.77	0.93%
9	24 大悦城 MTN001	债券	15,819,659.86	0.88%
10	22 甘国投 MTN002	债券	14,722,978.65	0.82%

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 180 天. 债权封闭 209 号	同业借款	3.5000	65	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）
首创证券股份有限公司	143930	庐陵二 3A	2,169,949.37

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	10257000000952434

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。