

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 188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 188 号 |
| 理财产品代码 | 23121188 |
| A 份额销售代码 | 23121188A |
| B 份额销售代码 | 23121188B |
| V 份额销售代码 | 23121188V |
| Z 份额销售代码 | 23121188Z |
| 产品登记编码 | Z7003923000378 |
| 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 | 107.44% |
| 产品起始日期 | 2023-10-25 |
| 产品终止日期 | 2024-11-13 |

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 | 1.0199 | 2,859,168,517.00 | 1.0199 | 2,916,070,362.16 | 1.08% |
| 2023-12-31 | 1.0090 | 2,859,168,517.00 | 1.0090 | 2,884,805,501.99 | |

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 | 1.0188 | 554,200.00 | 1.0188 | 564,621.96 | 1.02% |
| 2023-12-31 | 1.0085 | 554,200.00 | 1.0085 | 558,922.10 | |

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 | 1.0197 | 243,283,399.00 | 1.0197 | 248,069,317.20 | 1.07% |
| 2023-12-31 | 1.0089 | 243,283,399.00 | 1.0089 | 245,443,108.31 | |

Z 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 | 1.0193 | 75,834,948.00 | 1.0193 | 77,295,806.94 | 1.05% |
| 2023-12-31 | 1.0087 | 75,834,948.00 | 1.0087 | 76,494,632.75 | |

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 | 0.33% | 15.05% |
| 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 | 7.71% | 44.53% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 43.35% | 40.42% |
| 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 | 48.61% | 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 | 渤海信托.合肥鑫城控股集团.债权封闭 188 号 | 非标准化债权类 资产 | 431,275,715.30 | 12.38% |
| 2 | 渤海信托.中山城市建设集团有限公司.2023 安泰 45 号.债权封闭 188 号 | 非标准化债权类 资产 | 356,196,537.21 | 10.23% |
| 3 | 山东信托.洛阳国晟投资控股集团有限公司.融华 16 号.债权封闭 188 号 | 非标准化债权类 资产 | 220,298,408.98 | 6.32% |
| 4 | 渤海信托.六安市国有资产管理运营有限公司.2023 盈夏 11 号.债权封闭 188 号 | 非标准化债权类 资产 | 200,130,334.01 | 5.75% |
| 5 | 华鑫信托.江苏武进太湖湾旅游发展有限公司(第 2 期).债权 188 号 | 非标准化债权类 资产 | 200,123,184.54 | 5.75% |
| 6 | 19 简阳 01 | 债券 | 72,607,388.34 | 2.08% |
| 7 | 21 珞璜 02 | 债券 | 48,782,190.30 | 1.40% |
| 8 | 21 北碚 01 | 债券 | 47,038,373.35 | 1.35% |
| 9 | 21 涪新 03 | 债券 | 41,455,639.70 | 1.19% |
| 10 | 19 军融 02 | 债券 | 40,540,657.03 | 1.16% |

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 | 合肥鑫城控股集团有限公司 | 渤海信托.合肥鑫城控股集团有限公司.债权封闭 188 号 | 信托贷款 | 4.5870 | 226 | 正常 |
| 2 | 中山城市建设集团有限公司 | 渤海信托.中山城市建设集团有限公司.2023 安泰 45 号.债权封闭 188 号 | 信托贷款 | 4.3000 | 226 | 正常 |
| 3 | 洛阳国晟投资控股集团有限公司 | 山东信托.洛阳国晟投资控股集团有限公司.融华 16 号.债权封闭 188 号 | 信托贷款 | 5.0576 | 227 | 正常 |
| 4 | 六安市国有资产管理运营有限公司 | 渤海信托.六安市国有资产管理运营有限公司.2023 盈夏 11 号.债权封闭 188 号 | 信托贷款 | 4.6360 | 227 | 正常 |
| 5 | 江苏武进太湖湾旅游发展有限公司 | 华鑫信托.江苏武进太湖湾旅游发展有限公司(第 2 期). 债权 188 号 | 信托贷款 | 4.5091 | 226 | 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） |
|----------------|----------------------------------|--------------------------|------|----------------|
| 中诚信托有 限责任公司 | zcxthx18 OTC | 中诚信托-汇鑫 18 号 集合资金信托计划 | 买入 | 141,000,000.00 |
| 中诚信托有 限责任公司 | ZXD32Z2023 1101003500X OTC | 中诚信托-汇鑫 23 号 集合资金信托计划 | 买入 | 300,000.00 |
| 中诚信托有 限责任公司 | ZXD32Z2023 11010036947 OTC | 中诚信托-汇鑫 24 号 集合资金信托计划 | 买入 | 35,300,000.00 |

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

由于本产品为封闭式产品，故投资组合流动性风险较低，将根据产品的到期时间，做好流动性管理和变现安排。

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，产品持仓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

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 | 10257000000948086 |

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。