

华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财 产品 12 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	华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财产品 12 号
理财产品代码	22151012
A 份额销售代码	22151012A
B 份额销售代码	22151012B
C 份额销售代码	22151012C
产品登记编码	Z7003922000123
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	115.49%
产品起始日期	2023-03-23
产品终止日期	2024-04-23

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	1.0458	314,261,214.00	1.0458	328,666,830.39	1.07%
2023-12-31	1.0347	314,261,214.00	1.0347	325,167,479.83	

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	1.0453	10,337,000.00	1.0453	10,805,232.25	1.06%
2023-12-31	1.0343	10,337,000.00	1.0343	10,691,647.25	

C 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	1.0480	55,940,747.00	1.0480	58,623,924.12	1.14%
2023-12-31	1.0362	55,940,747.00	1.0362	57,968,056.86	

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	3.63%	11.65%
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%	53.67%
5	非标准化债权类资产	37.44%	32.67%
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%	2.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	58.93%	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	中诚信托.重庆市涪陵实业发展集团有限公司(君诚21号)422到期	非标准化债权类资产	75,115,241.92	16.34%
2	粤财信托.济南历城控股集团(慧融47号)第四期418到期	非标准化债权类资产	75,107,581.33	16.34%
3	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	53,558,038.21	11.65%
4	21吉控03	债券	15,723,959.97	3.42%
5	22威海03	债券	8,449,256.36	1.84%
6	21青岛银行二级02	债券	7,090,379.95	1.54%
7	20潍坊02	债券	6,372,253.73	1.39%
8	22保置01	债券	6,238,593.43	1.36%
9	22绿城01	债券	6,208,676.25	1.35%
10	21青岛银行二级	债券	5,173,607.49	1.13%

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	重庆市涪陵实业发展集团有限公司	中诚信托.重庆市涪陵实业发展集团有限公司(君诚21号)422到期	信托贷款	4.8500	22	正常
2	济南历城控股集团有限公司	粤财信托.济南历城控股集团(慧融47号)第四期418到期	信托贷款	4.9140	18	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

由于产品为封闭式产品，确保在产品到期时均将持仓资产变现，投资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

截止本报告日，债券价格波动处于合理的市场波动区间。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10250000003320125

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。