

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 107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 107 号 |
| 理财产品代码  | 23121107                 |
| 产品登记编码  | Z7003923000140           |
| 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    | 114.68%                  |
| 产品起始日期  | 2023-06-01               |
| 产品终止日期  | 2024-07-03               |

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

| 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 | 1.0387      | 447,918,294.00 | 1.0387      | 465,259,850.05 | 1.15%       |
| 2023-12-31 | 1.0269      | 447,918,294.00 | 1.0269      | 459,965,768.09 |             |

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       | 0.04%     | 5.80%     |
| 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%     | 56.67%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 42.84%    | 37.53%    |
| 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        | 57.12%    | 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.江苏开晟产业发展集团有限公司理财融资项目.建业 80 号                           | 非标准化债权类<br>资产 | 150,171,119.10 | 28.14%      |
| 2  | 渤海信托.重庆空港新城开发建设有<br>限公司理财融资项目第一期(106 号<br>/107 号/78 号/27 号) | 非标准化债权类<br>资产 | 50,055,323.42  | 9.38%       |
| 3  | 23 海资 03  | 债券            | 13,941,405.42  | 2.61%       |
| 4  | 中行苏州高新技术产业开发区支行<br>20231026-40                              | 现金及银行存款       | 11,976,019.75  | 2.24%       |
| 5  | 22 新海连 MTN002   | 债券            | 11,305,972.50  | 2.12%       |
| 6  | 22 首股 02  | 债券            | 8,324,857.24   | 1.56%       |
| 7  | 23 科城 Y2  | 债券            | 8,258,706.02   | 1.55%       |
| 8  | 23 黄发 02  | 债券            | 7,190,914.82   | 1.35%       |
| 9  | 23 信达地产 PPN001  | 债券            | 7,179,091.71   | 1.35%       |
| 10 | 22 金阳投资 PPN001  | 债券            | 7,131,113.67   | 1.34%       |

### 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  | 江苏开晟产业发展集团有限公司 | 华鑫信托.江苏开晟产业发展集团有限公司理财融资项目. 建业 80 号              | 信托贷款 | 4.7722 | 93      | 正常   |
| 2  | 重庆空港新城开发建设有限公司 | 渤海信托.重庆空港新城开发建设有限公司理财融资项目第一期(106号/107号/78号/27号) | 信托贷款 | 4.6500 | 92      | 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<br>限责任公司 | ZC1A2W<br>OTC | 中诚信托-汇鑫 14 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 26,500,000.00 |

## 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

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

### 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 | 10250000003369092 |

## 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。