

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 101 号

2024 年第 2 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 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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 101 号
理财产品代码	23121101
产品登记编码	Z7003923000135
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	124.12%
产品起始日期	2023-04-19
产品终止日期	2024-08-13

第二章 净值、存续规模及收益表现

2.1 净值和存续规模

估值日期	份额净值 (元)	份额总数(份)	累计净值 (元)	资产净值(元)
2024-06-30	1.0544	1,998,689,486.00	1.0544	2,107,434,593.91

2.2 净值增长率

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年3月31日-2024年6月30日	0.98%
成立以来	2023年4月19日-2024年6月30日	5.44%
2023年	2023年4月19日-2023年12月31日	3.28%

注：净值增长率=(期末累计净值-期初累计净值)/期初份额净值*100%；因投资者赎回可能导致在某个时期部分份额为0，该情形下净值增长率的所属区间不连续；年末份额为0时，该年度净值增长率为空；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，投资须谨慎。

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	0.20%	0.53%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.26%
4	债券	0.00%	63.37%
5	非标准化债权类资产	42.50%	34.37%
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%	0.46%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	57.30%	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	山东信托·岳阳市城市建设投资集团有限公司理财融资项目第二期(固收债权封闭 101 号)	非标准化债权类资产	400,502,995.52	15.31%
2	中信信托·溧阳市苏顺运营管理集团有限公司·第一期	非标准化债权类资产	398,514,099.27	15.24%
3	粤财信托·四川旅投 1 号·第二期	非标准化债权类资产	100,118,922.82	3.83%
4	21 金阳 02	债券	88,978,333.39	3.40%
5	19 连云港 MTN003	债券	80,506,213.93	3.08%
6	19 潍东 03	债券	76,043,210.45	2.91%
7	19 信投 03	债券	67,059,177.25	2.56%
8	21 安紫 01	债券	48,819,503.71	1.87%
9	21 北建 01	债券	48,186,743.19	1.84%
10	19 北汽 06	债券	47,717,796.76	1.82%

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	岳阳市城市建设投资集团有限公司	山东信托.岳阳市城市建设投资集团有限公司理财融资项目第二期(固收债权封闭101号)	信托贷款	4.6200	44	正常
2	溧阳市苏顺运营管理集团有限公司	中信信托.溧阳市苏顺运营管理集团有限公司.第一期	信托贷款	4.7320	44	正常
3	四川省旅游投资集团有限责任公司	粤财信托.四川旅投1号.第二期	信托贷款	4.8218	43	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	144379.SZ	庐陵二 4A	7,603.46
招商证券股份有限公司	144183.SZ	天下 4 优 2	2,491,723.50
招商证券股份有限公司	2489123.IB	24 海鑫 1B	10,536.37

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）
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2024 0101002600X OTC	中诚信托-汇鑫 29 号 集合资金信托计划	买入	458,900,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2024 01010032472 OTC	中诚信托-汇鑫 30 号 集合资金信托计划	买入	51,430,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2024 01010055251 OTC	中诚信托-汇鑫 32 号 集合资金信托计划	买入	53,000,000.00

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

本产品在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2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	10250000003363635

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。