

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 157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 157 号
理财产品代码	23121157
产品登记编码	Z7003923000250
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	106.32%
产品起始日期	2023-09-08
产品终止日期	2024-10-09

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	1.0356	1,233,303,423.00	1.0356	1,277,204,586.80

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9月8日-2024年6月30日	3.56%
2023年	2023年9月8日-2023年12月31日	1.39%

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	0.33%	30.17%
2	同业存单	0.00%	0.07%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.04%
4	债券	0.00%	27.70%
5	非标准化债权类资产	42.85%	40.55%
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%	0.48%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	56.82%	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	农业银行合肥经济技术开发区支行 35 (20240628)	现金及银行存款	404,895,209.70	29.82%
2	中信信托.德清县建设发展集团有限 公司.华信 33 号.债权封闭 157 号	非标准化债权类 资产	400,389,803.15	29.48%
3	山东信托.洛阳国晟.融华 16 号.债权 封闭 171 号.167 号.157 号	非标准化债权类 资产	150,209,728.79	11.06%
4	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	14,135,277.63	1.04%
5	20 济宁城投永续期债	债券	13,191,577.44	0.97%
6	22 宣城经开 PPN001	债券	11,281,919.19	0.83%
7	23 青租 03	债券	9,508,567.52	0.70%
8	湘江 22Y	债券	9,452,907.80	0.70%
9	23 中交 01	债券	9,325,907.27	0.69%
10	24 兴信 01	债券	7,588,554.82	0.56%

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	德清县建设发展集团有限公司	中信信托.德清县建设发展集团有限公司.华信 33 号.债权封闭 157 号	信托贷款	4.3065	100	正常
2	洛阳国晟投资控股集团有限公司	山东信托.洛阳国晟.融华 16 号.债权封闭 171 号.167 号.157 号	信托贷款	5.0576	100	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）
兴业国信资产管理有限 公司	240805	24 兴信 01	12,063,839.51

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

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

截至本报告日,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

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	1025700000943043

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。