

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 199 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 199 号
理财产品代码	23121199
A 份额销售代码	23121199A
产品登记编码	Z7003923000389
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	106.77%
产品起始日期	2023-12-15
产品终止日期	2025-04-08

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

### 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	1.0251	414,789,302.00	1.0251	425,187,918.91

### 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	1.11%
成立以来	2023年12月15日-2024年6月30日	2.51%
<b>2023年</b>	2023年12月15日-2023年12月31日	0.23%

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	2.69%	2.80%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.32%
4	债券	0.00%	55.14%
5	非标准化债权类资产	43.27%	40.66%
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%	1.08%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	54.04%	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	中信信托·济南城市投资集团·债权封闭 199 号·百岁三年定开 12 号	非标准化债权类 资产	180,151,671.93	39.68%
2	天虹 20 优	债券	15,761,956.50	3.47%
3	20 网商银行永续债 01	债券	13,310,630.66	2.93%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	12,721,092.06	2.80%
5	22 首股 04	债券	10,983,475.85	2.42%
6	22 金融街投 MTN001	债券	10,964,781.24	2.42%
7	22 海通恒信 MTN002	债券	10,665,814.04	2.35%
8	21 齐鲁银行永续债	债券	10,258,473.76	2.26%
9	22 建发地产 MTN005	债券	8,803,806.57	1.94%
10	22 青岛银行永续债 02	债券	6,305,274.56	1.39%

### 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	济南城市投资集团有限公司	中信信托.济南城市投资集团.债权封闭 199 号.百岁三年定开 12 号	信托贷款	4.5335	275	正常
2	杭州大江东城市基础设施建设有限公司	杭工信托.杭州大江东城市基础设施建设有限公司.尊利 29 号.债权封闭 199 号	信托贷款	4.4334	270	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）
国信证券股份有限公司	102100867.IB	21 平湖城投 MTN002	696,742.14

#### 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

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控；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可能出现的流动性风险。

### 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总体资质较优。产品组合久期控制在合理范围内，债券资产价格波动对组合净值影响保持在可控范围内。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无权益类仓位。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品仓位。

## 第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000954168

## 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。