

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 216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：中信银行股份有限公司

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 216 号 |
| 理财产品代码 | 23121216 |
| 产品登记编码 | Z7003923000447 |
| 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 | 102.70% |
| 产品起始日期 | 2023-10-31 |
| 产品终止日期 | 2024-12-02 |

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 | 1.0289 | 183,641,584.00 | 1.0289 | 188,949,471.47 |

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 | 0.87% |
| 成立以来 | 2023年10月31日-2024年6月30日 | 2.89% |
| 2023年 | 2023年10月31日-2023年12月31日 | 0.90% |

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 | 3.26% | 4.62% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 9.33% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 9.47% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 34.28% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 43.29% | 42.29% |
| 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 | 53.45% | 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 | 渤海信托.合肥鑫城控股集团.债权封 闭 216 号 | 非标准化债权类 资产 | 82,061,716.11 | 42.29% |
| 2 | 债券买入返售 | 拆放同业及债券 买入返售 | 18,384,372.89 | 9.47% |
| 3 | 存款及清算款等现金类资产 | 现金及银行存款 | 8,972,996.45 | 4.62% |
| 4 | 24 青岛海控 SCP003 | 债券 | 5,618,205.12 | 2.90% |
| 5 | 20 农业银行永续债 01 | 债券 | 4,748,626.98 | 2.45% |
| 6 | 16 广州地铁永续期债 03 | 债券 | 4,620,176.84 | 2.38% |
| 7 | 21 珠海港 MTN006 | 债券 | 3,881,364.33 | 2.00% |
| 8 | 20 农业银行二级 01 | 债券 | 3,786,240.27 | 1.95% |
| 9 | 24 中信银行 CD127 | 同业存单 | 3,623,771.27 | 1.87% |
| 10 | 24 农业银行 CD058 | 同业存单 | 3,623,173.71 | 1.87% |

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 | 合肥鑫城控股集团有限公司 | 渤海信托.合肥鑫城控股集团.债权封闭 216 号 | 信托贷款 | 4.5870 | 154 | 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） |
|------------------------|-----------|---------------|---------------|
| 广发银行股份有限公司 | 112420141 | 24 广发银行 CD141 | 1,540,177.58 |
| 平安银行股份有限公司 | 112411069 | 24 平安银行 CD069 | 12,207,162.32 |
| 平安银行股份有限公司 | 2028003 | 20 平安银行永续债 01 | 777,265.71 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410101 | 24 兴业银行 CD101 | 2,265,235.60 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410122 | 24 兴业银行 CD122 | 2,262,083.63 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112405123 | 24 建设银行 CD123 | 1,609,456.05 |
| 中信银行股份有限公司 (托管人关联方) | 112408140 | 24 中信银行 CD140 | 6,111,075.46 |
| 中信银行股份有限公司 (托管人关联方) | 112408127 | 24 中信银行 CD127 | 1,612,239.12 |
| 中信银行股份有限公司 (托管人关联方) | 112408143 | 24 中信银行 CD143 | 2,264,294.09 |

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 限责任公司 | ZXD32Z2023 11010036947 OTC | 中诚信托-汇鑫 24 号 集合资金信托计划 | 买入 | 51,000,000.00 |

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 | 8110501013302364887 |

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。