

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 86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 86 号 |
| 理财产品代码 | 23121086 |
| A 份额销售代码 | 23121086A |
| 产品登记编码 | Z7003923000101 |
| 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 | 114.41% |
| 产品起始日期 | 2023-03-23 |
| 产品终止日期 | 2024-09-24 |

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 | 1.0556 | 247,316,511.00 | 1.0556 | 261,072,928.90 |

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 | 0.97% |
| 成立以来 | 2023年3月23日-2024年6月30日 | 5.56% |
| 2023年 | 2023年3月23日-2023年12月31日 | 3.54% |

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 | 0.07% | 0.67% |
| 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% | 53.62% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 42.36% | 37.20% |
| 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% | 8.51% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 57.57% | 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 | 粤财信托.安庆盛唐投资控股集团 (惠融 43 号) 第二期 0923 到期 | 非标准化债权类 资产 | 61,064,081.85 | 20.44% |
| 2 | 粤财信托.安庆新能源投资发展有限 公司(惠融 44 号) | 非标准化债权类 资产 | 50,052,526.12 | 16.76% |
| 3 | 19 冶 23B | 债券 | 6,457,890.98 | 2.16% |
| 4 | 摩根亚洲债券人民币累计 | 公募基金 | 5,890,575.97 | 1.97% |
| 5 | 24 鹤投 01 | 债券 | 5,681,203.01 | 1.90% |
| 6 | 24 保利 01 | 债券 | 5,623,965.06 | 1.88% |
| 7 | 十七 01B | 债券 | 4,777,836.95 | 1.60% |
| 8 | 23 中原银行永续债 01 | 债券 | 4,406,836.35 | 1.48% |
| 9 | 21 长城人寿 01 | 债券 | 4,178,866.26 | 1.40% |
| 10 | 19 铜梁 01 | 债券 | 4,117,007.88 | 1.38% |

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 | 安庆盛唐投资控股集团有限公司 | 粤财信托.安庆盛唐投资控股集团(惠融43号)第二期0923到期 | 信托贷款 | 4.8270 | 85 | 正常 |
| 2 | 安庆新能源投资发展有限公司 | 粤财信托.安庆新能源投资发展有限公司(惠融44号) | 信托贷款 | 4.8270 | 85 | 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） |
|------------|--------------|---------------|--------------|
| 兴业银行股份有限公司 | 242480002.IB | 24 兴业银行永续债 01 | 1,415,618.78 |

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 | ZC1A34 OTC | 中诚信托-汇鑫 15 号 集合资金信托计划 | 买入 | 1,200,000.00 |

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,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

截至本报告日,产品投资的债券资产总体资质较优,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 | 10250000003356232 |

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。