

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 87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 87 号
理财产品代码	23121087
A 份额销售代码	23121087A
B 份额销售代码	23121087B
产品登记编码	Z7003923000102
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	114.51%
产品起始日期	2023-04-04
产品终止日期	2024-10-15

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

A 份额：

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	1.0520	302,327,530.00	1.0520	318,045,170.56

B 份额：

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	1.0514	21,396,430.00	1.0514	22,495,690.71

2.2 净值增长率

A 份额：

	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	0.93%
成立以来	2023年4月4日-2024年6月30日	5.20%
2023年	2023年4月4日-2023年12月31日	3.27%

B 份额：

	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	0.92%
成立以来	2023年4月4日-2024年6月30日	5.14%
2023年	2023年4月4日-2023年12月31日	3.23%

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	0.06%	0.66%
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%	53.61%
5	非标准化债权类资产	42.38%	37.22%
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	57.56%	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·济南市中财金投资集团有限公司(慧融 46 号)第二期	非标准化债权类 资产	95,103,702.98	24.39%
2	粤财信托·安庆盛唐投资控股集团(惠融 43 号)第三期 1014 到期	非标准化债权类 资产	50,048,972.31	12.83%
3	19 冶 23B	债券	8,429,048.12	2.16%
4	摩根亚洲债券人民币累计	公募基金	7,688,570.23	1.97%
5	24 鹤投 01	债券	7,415,289.87	1.90%
6	24 保利 01	债券	7,340,581.04	1.88%
7	十七 01B	债券	6,236,187.28	1.60%
8	23 中原银行永续债 01	债券	5,751,945.30	1.48%
9	21 长城人寿 01	债券	5,454,391.37	1.40%
10	19 铜梁 01	债券	5,373,651.80	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	济南市中财金投资集团有限公司	粤财信托.济南市中财金投资集团有限公司(惠融46号)第二期	信托贷款	5.0110	88	正常
2	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有限公司(惠融43号)第三期 1014 到期	信托贷款	4.8270	106	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	1,848,823.70

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	1,800,000.00

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	10250000003359197

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。