

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 237 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 237 号 |
| 理财产品代码  | 24121237                 |
| 产品登记编码  | Z7003923000485           |
| 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    | 100.10%                  |
| 产品起始日期  | 2024-01-18               |
| 产品终止日期  | 2024-07-22               |

## 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<br>(元) | 份额总数(份)        | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)        |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|
| 2024-06-30 | 1.0168      | 233,449,938.00 | 1.0168      | 237,390,116.71 |

### 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 | 0.89% |
| 成立以来 | 2024年1月18日-2024年6月30日 | 1.68% |

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       | 0.37%     | 98.71%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 1.29%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 0.00%     |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 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        | 99.63%    | 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------------------|---------|---------------|-------------|
| 1  | 农业银行合肥金寨路支行<br>20240627-20 | 现金及银行存款 | 64,391,539.19 | 27.10%      |
| 2  | 农业银行南京六合 230728/15         | 现金及银行存款 | 49,551,561.49 | 20.85%      |
| 3  | 农业银行南京六合 230815/10         | 现金及银行存款 | 32,975,386.46 | 13.88%      |
| 4  | 存款及清算款等现金类资产               | 现金及银行存款 | 30,109,163.60 | 12.67%      |
| 5  | 建设银行徐州分行 20231207-20       | 现金及银行存款 | 8,512,614.43  | 3.58%       |
| 6  | 建设银行南京江宁支行 20231205-20     | 现金及银行存款 | 8,512,152.44  | 3.58%       |
| 7  | 建设银行秦淮支行 20231205-20       | 现金及银行存款 | 8,512,152.44  | 3.58%       |
| 8  | 建设银行沭阳支行 20231208-15.2     | 现金及银行存款 | 6,471,110.87  | 2.72%       |
| 9  | 建设银行宝应华夏支行 20231130-10     | 现金及银行存款 | 4,256,524.16  | 1.79%       |
| 10 | 建设银行涟水支行 20231208-10       | 现金及银行存款 | 4,255,930.41  | 1.79%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(天) | 风险状况 |
|----|------|------|------|------------|-------------|------|
| -  | -    | -    | -    | -          | -           | -    |

### 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 | 232480020 | 24 兴业银行二级资本债<br>01 | 774,274.26   |
| 兴业银行股份有限公司 | 242480002 | 24 兴业银行永续债 01      | 1,002,881.33 |

#### 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<br>限责任公司 | ZXD32Z2023<br>11010036947<br>OTC | 中诚信托-汇鑫 24 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 148,000,000.00 |

## 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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向非标资产及资产管理计划。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，做好流动性管理。

### 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

截止本报告日，本产品投资的债券价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，本产品无权益持仓。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

## 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号              |
|----|------|-------------------|
| 1  | 托管账户 | 10257000000963604 |

## 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。