

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 88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 88 号
理财产品代码	23121088
产品登记编码	Z7003923000107
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	101.18%
产品起始日期	2023-03-29
产品终止日期	2025-04-22

## 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 (元)	份额总数(份)	累计净值 (元)	资产净值(元)
2024-06-30	1.0292	210,212,261.00	1.0592	216,352,670.45

### 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	0.96%
成立以来	2023年3月29日-2024年6月30日	5.92%
<b>2023年</b>	2023年3月29日-2023年12月31日	3.75%

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	0.35%	0.76%
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%	75.93%
5	非标准化债权类资产	23.32%	23.31%
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	76.33%	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)第一期0326到期	非标准化债权类 资产	50,021,793.19	22.85%
2	23 金阳投资 PPN001	债券	10,135,638.08	4.63%
3	20 常投 01	债券	10,107,507.52	4.62%
4	23 常德城投 PPN004	债券	10,035,754.07	4.58%
5	22 六安城投 PPN001	债券	10,029,949.53	4.58%
6	22 德阳产投 MTN001	债券	9,056,226.96	4.14%
7	22 济宁高新 MTN001	债券	8,062,008.11	3.68%
8	22 太湖湾 PPN001	债券	6,102,047.45	2.79%
9	23 洛阳城乡 PPN001	债券	6,067,181.70	2.77%
10	23 建发 01	债券	6,042,771.86	2.76%

### 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) 第一期 0326 到期	信托贷款	4.8270	269	正常
2	徐州经济技术开发区国有资产经营有限责任公司	西藏信托.徐州经济技术开发区国有资产经营有限责任公司.云旗 36 号.债权封闭 88 号	信托贷款	4.3740	295	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）
-	-	-	-

#### 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）
2024-04-01	200
2024-06-27	100



## 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、债券类资产,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

本产品持仓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

截至本报告日,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

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	10250000003357178

## 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。