

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 214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：中国民生银行股份有限公司

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 214 号
理财产品代码	23121214
M 份额销售代码	23121214M
S 份额销售代码	23121214S
W 份额销售代码	23121214W
Z 份额销售代码	23121214Z
产品登记编码	Z7003923000439
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	102.68%
产品起始日期	2023-12-08
产品终止日期	2025-02-11

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

M 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	1.0208	301,186,905.00	1.0208	307,457,317.51

S 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	1.0213	675,953,548.00	1.0213	690,374,195.28

W 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	1.0213	147,628,822.00	1.0213	150,778,303.66

Z 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	1.0213	46,077,738.00	1.0213	47,060,750.61

2.2 净值增长率

M 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	0.89%
成立以来	2023年12月8日-2024年6月30日	2.08%
2023年	2023年12月8日-2023年12月31日	0.24%

S 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	0.91%

成立以来	2023年12月8日-2024年6月30日	2.13%
2023年	2023年12月8日-2023年12月31日	0.25%

W 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	0.91%
成立以来	2023年12月8日-2024年6月30日	2.13%
2023年	2023年12月8日-2023年12月31日	0.25%

Z 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	0.91%
成立以来	2023年12月8日-2024年6月30日	2.13%
2023年	2023年12月8日-2023年12月31日	0.25%

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	0.49%	32.39%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.68%
4	债券	0.00%	39.63%
5	非标准化债权类资产	24.29%	23.66%
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%	3.63%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	75.22%	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	外贸信托.抖音月付承接池.债权 189.193.223.214 号	非标准化债权类 资产	150,354,232.03	12.25%
2	中信信托.盐城市城南新区开发建设 投资有限公司.华信 47.债权封闭 214 号	非标准化债权类 资产	100,097,883.60	8.15%
3	建设银行溧阳嘉丰支行 20231215-35	现金及银行存款	93,285,899.48	7.60%
4	北京信托.绍兴市科技创业投资有限 公司.润N 480 号.债权 197 号.增强精 选 49 号.债权封闭 214 号	非标准化债权类 资产	40,032,547.45	3.26%
5	建设银行盱眙支行 20231213-15	现金及银行存款	39,987,176.20	3.26%
6	建设银行南京城中支行 20231213-15	现金及银行存款	39,987,176.20	3.26%
7	建设银行南京溧水支行 20231214-15	现金及银行存款	39,983,423.70	3.26%
8	22 龙岩汇金 MTN002	债券	27,192,523.40	2.21%
9	22 义乌商品 MTN001	债券	26,957,454.28	2.20%
10	23 宜春发展 CP003	债券	26,898,154.06	2.19%

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	非特定消费信贷客户	外贸信托.抖音月付承接池.债权 189.193.223.214号	信托贷款	4.2000	162	正常
2	盐城市城南新区开发建设投资有限公司	中信信托.盐城市城南新区开发建设投资有限公司.华信 47.债权封闭 214 号	信托贷款	5.5008	208	正常
3	绍兴市科技创业投资有限公司	北京信托.绍兴市科技创业投资有限公司.润 N 480 号.债权 197 号.增强精选 49 号.债权封闭 214 号	信托贷款	4.9600	208	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）
-	-

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。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。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，根据到期日市场情况及产品申赎特点，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，产品投资的债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益类资产持仓。

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	643252183

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。