

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 249 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 249 号
理财产品代码	24121249
A 份额销售代码	24121249A
Z 份额销售代码	24121249Z
产品登记编码	Z7003924000003
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	106.31%
产品起始日期	2024-02-07
产品终止日期	2025-03-03

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	1.0152	405,406,150.00	1.0152	411,583,854.17

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	1.0150	88,235,020.00	1.0150	89,561,953.89

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	0.99%
成立以来	2024年2月7日-2024年6月30日	1.52%

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	0.98%
成立以来	2024年2月7日-2024年6月30日	1.50%

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	1.39%	1.38%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.28%
4	债券	0.00%	53.70%
5	非标准化债权类资产	43.49%	40.93%
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	2.95%	3.71%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	52.17%	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	杭工信托.杭州大江东城市基础设施建设有限公司.尊利 29 号.臻享私募 71 号.臻享私募 54 号.债权封闭 249 号	非标准化债权类资产	100,503,815.42	18.86%
2	陆家嘴信托.长沙开福城投集团.华禧 1 号.债权封闭 249 号	非标准化债权类资产	100,052,554.46	18.78%
3	光大兴陇信托.江苏武进绿色建筑产业投资有限公司.泓华 11 号.债权封闭 249 号	非标准化债权类资产	16,528,850.48	3.10%
4	20 网商银行永续债 01	债券	9,408,068.03	1.77%
5	16 广州地铁永续期债 03	债券	7,424,788.24	1.39%
6	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	7,325,840.05	1.38%
7	22 武新城	债券	7,036,881.51	1.32%
8	国投瑞银优化增强债券 A/B	公募基金	5,834,095.83	1.10%
9	22 金茂 01	债券	5,573,991.19	1.05%
10	22 信地 02	债券	5,553,116.11	1.04%

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	杭州大江东城市基础设施建设有限公司	杭工信托.杭州大江东城市基础设施建设有限公司.尊利 29 号.臻享私募 71 号.臻享私募 54 号.债权封闭 249 号	信托贷款	4.4334	243	正常
2	长沙开福城投集团有限责任公司	陆家嘴信托.长沙开福城投集团.华禧 1 号.债权封闭 249 号	信托贷款	4.4000	243	正常
3	江苏武进绿色建筑产业投资有限公司	光大兴陇信托.江苏武进绿色建筑产业投资有限公司.泓华 11 号.债权封闭 249 号	信托贷款	4.4334	243	正常
4	南京江宁水务集团有限公司	西部信托.南京江宁水务集团.桂宸 4 号.债权封闭 249 号	信托贷款	4.3003	243	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）
国信证券股份有限公司	102100867.IB	21 平湖城投 MTN002	470,371.89

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

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对可能出现的流动性风险。

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。产品组合久期控制在合理范围内，债券资产价格波动对组合净值影响保持在可控范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无权益类仓位。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品仓位。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000965454

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。