

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 229 号

2024 年第 3 季度报告

重要信息提示：

- 1、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。
- 2、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 7 月 1 日至 2024 年 9 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 229 号
理财产品代码	23121229
M 份额销售代码	23121229M
产品登记编码	Z7003923000479
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	107.75%
产品起始日期	2024-05-08
产品终止日期	2025-07-02

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

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)
2024-09-30	1.0116	513,633,781.00	1.0116	519,599,821.89

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6月30日-2024年9月30日	0.72%
成立以来	2024年5月8日-2024年9月30日	1.16%

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	0.21%	0.93%
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%	73.80%
5	非标准化债权类资产	23.10%	21.45%
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%	3.82%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	76.69%	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	上海信托.长兴交通投资集团有限公司理财融资项目(第一期).债权 279. 债权 229 号	非标准化债权类 资产	80,035,069.91	14.30%
2	杭工信托.杭州余杭城市发展投资集团有限公司理财融资项目(第五期). 尊利 119 号.债权封闭 279.229 号.增 强封闭 98 号	非标准化债权类 资产	40,025,059.64	7.15%
3	博时可转债 ETF	公募基金	12,732,305.24	2.27%
4	22 碧桂园 MTN001	债券	10,052,672.51	1.80%
5	23 碧桂园 MTN002	债券	6,827,164.09	1.22%
6	22 旭辉集团 MTN002	债券	6,708,083.79	1.20%
7	23 海资 03	债券	5,880,582.82	1.05%
8	24 津材 01	债券	5,831,051.49	1.04%
9	22 迪荡投资债 01	债券	5,768,522.51	1.03%
10	24 陕西机械 MTN001(科创票据)	债券	5,435,870.23	0.97%

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	长兴交通投资集团有限公司	上海信托.长兴交通投资集团有限公司理财融资项目(第一期).债权 279. 债权 229 号	信托贷款	4.4300	274	正常
2	杭州余杭城市发展投资集团有限公司	杭工信托.杭州余杭城市发展投资集团有限公司理财融资项目(第五期). 尊利 119 号.债权封闭 279.229 号.增强封闭 98 号	信托贷款	3.8000	273	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）
中国民生银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	1,181,144.53

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	ZC19HA	中诚信托-嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	49,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC1A2W	中诚信托-汇鑫 14 号 集合资金信托计划	买入	128,000,000.00

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

流动性风险控制方面, 本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上, 确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例, 并随着风险收益特征的相对变化及时调整; 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流动性风险。具体包括: 一是跟踪资金申购赎回情况, 提前备付流动资金; 二是根据产品的期限, 合理制定组合加权久期, 预防流动性风险; 三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

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

截至本报告日, 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	645543450

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。