

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 160 号

2024 年第 4 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 10 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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 160 号
理财产品代码	23121160
产品登记编码	Z7003923000245
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	101.24%
产品起始日期	2023-08-29
产品终止日期	2025-09-16

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)
2024-12-31	1.0022	346,537,185.00	1.0522	347,290,551.91

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09月30日-2024年12月31日	1.09%
成立以来	2023年08月29日-2024年12月31日	5.22%
2023年	2023年08月29日-2023年12月31日	1.31%

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	0.04%	0.38%
2	同业存单	0.00%	0.25%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	3.71%
4	债券	0.00%	70.28%
5	非标准化债权类资产	24.89%	24.62%
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%	0.75%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	75.07%	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	中信信托·盐城市交通投资建设控股集团·华信 22	非标准化债权类 资产	86,574,908.10	24.62%
2	23 温州交通 MTN002	债券	19,940,520.81	5.67%
3	22 建发地产 MTN005	债券	19,937,346.08	5.67%
4	22 安控 07	债券	19,927,595.95	5.67%
5	22 营财 01	债券	19,923,990.13	5.67%
6	23 西安高新 PPN002	债券	19,892,617.63	5.66%
7	22 东交 01	债券	19,870,697.30	5.65%
8	23 中广核租 MTN002(碳中和债)	债券	17,342,180.74	4.93%
9	22 国海 02	债券	13,604,887.63	3.87%
10	22 海通恒信 MTN002	债券	13,329,430.69	3.79%

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(%)	剩余期限(天)	风险状况
1	盐城市交通投资建设控股集团有限公司	中信信托.盐城市交通投资建设控股集团有限公司.华信 22	信托贷款	5.0140	241	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）
招商证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	359,169.29

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	ZCXTJX03	中诚信托-嘉信配置 3 号	买入	56,500,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZXD32Z2024 01010032472	中诚信托-汇鑫 30 号	买入	24,030,000.00

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份理财份额分红数（元）
2024-12-26	500

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品为封闭式产品,故投资组合流动性风险较低,将根据产品的到期时间,做好流动性管理和变现安排。

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,债券价格波动处于市场合理区间范围。

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

截至本报告日,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	641146463

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。