

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 263 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：华夏银行股份有限公司

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 263 号
理财产品代码	24121263
A 份额销售代码	24121263A
B 份额销售代码	24121263B
产品登记编码	Z7003924000052
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	107.54%
产品起始日期	2024-04-24
产品终止日期	2025-08-25

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)
2024-12-31	1.0236	355,090,331.00	1.0236	363,495,963.99

B 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)
2024-12-31	1.0233	338,000.00	1.0233	345,882.31

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09月30日-2024年12月31日	1.19%
成立以来	2024年04月24日-2024年12月31日	2.36%

B 份额：

	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	1.18%
成立以来	2024年04月24日-2024年12月31日	2.33%

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	4.11%	4.06%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.26%
4	债券	0.00%	55.77%
5	非标准化债权类资产	41.21%	38.37%
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%	1.54%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	54.67%	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	北京信托.青岛城市建设投资(集团)有限责任公司.润昇财富 543 号.臻享私募 107 号.债权封闭 263 号	非标准化债权类资产	100,090,705.21	25.58%
2	上海信托.赣州旅游投资集团有限公司理财融资项目(第三期).债权 263 号	非标准化债权类资产	29,034,081.93	7.42%
3	北京信托.宁波慈溪城建投资集团有限公司理财融资项目(第一期).润昇财富 522 号.债权 263 号	非标准化债权类资产	21,012,066.30	5.37%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	15,883,888.15	4.06%
5	24 保利发展 MTN003	债券	7,790,740.49	1.99%
6	20 桂交 01	债券	4,606,694.16	1.18%
7	22 绿城地产 MTN005	债券	4,201,665.86	1.07%
8	东财瑞利债券 A	公募基金	3,697,396.92	0.94%
9	23 西安高新 MTN004	债券	3,679,291.26	0.94%
10	24 陕投集团 MTN002	债券	3,581,998.76	0.92%

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	青岛城市建设投资(集团)有限责任公司	北京信托.青岛城市建设投资(集团)有限责任公司.润昇财富 543 号.臻享私募 107 号.债权封闭 263 号	信托贷款	4.0790	231	正常
2	赣州旅游投资集团有限公司	上海信托.赣州旅游投资集团有限公司理财融资项目(第三期).债权 263 号	信托贷款	4.9200	237	正常
3	宁波慈溪城建投资集团有限公司	北京信托.宁波慈溪城建投资集团有限公司理财融资项目(第一期).润昇财富 522 号.债权 263 号	信托贷款	4.1000	237	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	697,550.53

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	10257000000972483

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。