

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 216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：中信银行股份有限公司

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 216 号
理财产品代码	23121216
产品登记编码	Z7003923000447
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	105.64%
产品起始日期	2023-10-31
产品终止日期	2024-12-02

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	1.0366	183,641,584.00	1.0366	190,370,142.72

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	0.75%
成立以来	2023年10月31日-2024年9月30日	3.66%
2023年	2023年10月31日-2023年12月31日	0.90%

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	1.00%	9.45%
2	同业存单	0.00%	4.19%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	3.99%
4	债券	0.00%	41.56%
5	非标准化债权类资产	43.07%	40.82%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	55.93%	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	渤海信托.合肥鑫城控股集团.债权封 闭 216 号	非标准化债权类 资产	82,087,486.03	40.82%
2	24 珠海华润银行 CD064	同业存单	8,419,269.71	4.19%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	8,022,731.51	3.99%
4	24 广发 D5	债券	4,306,682.49	2.14%
5	建行溧阳嘉丰支行 20231215	现金及银行存款	3,763,780.79	1.87%
6	21 渤海银行二级	债券	3,451,714.54	1.72%
7	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	3,400,747.51	1.69%
8	24 华福证券 CP003	债券	2,580,078.05	1.28%
9	22 华融湘江二级资本债 01	债券	2,566,651.14	1.28%
10	20 平安银行永续债 01	债券	1,764,106.58	0.88%

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	合肥鑫城控股集团有限公司	渤海信托.合肥鑫城控股集团.债权封闭 216 号	信托贷款	4.5870	62	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）
兴业银行股份有限公司	112410052	24 兴业银行 CD052	1,891,096.47
中国建设银行股份有限公司	112405145	24 建设银行 CD145	1,891,939.78

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	8110501013302364887

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。