

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 261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：华夏银行股份有限公司

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 261 号
理财产品代码	24121261
A 份额销售代码	24121261A
Z 份额销售代码	24121261Z
产品登记编码	Z7003924000047
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	104.80%
产品起始日期	2024-04-25
产品终止日期	2025-05-20

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)
2024-09-30	1.0116	799,631,120.00	1.0116	808,928,813.65

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)
2024-09-30	1.0111	936,181,967.00	1.0111	946,658,683.81

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6月30日-2024年9月30日	0.58%
成立以来	2024年4月25日-2024年9月30日	1.16%

Z 份额：

	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	0.55%
成立以来	2024年4月25日-2024年9月30日	1.11%

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	0.24%	3.66%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.13%
4	债券	0.00%	44.62%
5	非标准化债权类资产	44.22%	42.23%
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	9.14%	9.36%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	46.39%	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	建元信托.山东省新动能基金管理有 限公司理财融资项目.启航鼎 27 号. 债权封闭 261 号	非标准化债权类 资产	150,110,889.54	8.16%
2	上海信托.湖州经开投资发展集团有 限公司理财融资项目(第二期).湖 州 2 号.债权封闭 261 号	非标准化债权类 资产	100,057,856.34	5.44%
3	上海信托.长兴交通投资集团有限公 司理财融资项目(第二期).债权 261 号	非标准化债权类 资产	100,052,055.28	5.44%
4	上海信托.赣州旅游投资集团有限公 司理财融资项目(第一期).债权 261.275 号	非标准化债权类 资产	80,081,448.73	4.35%
5	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(第一期). 尊利 119 号.债权封闭 261 号	非标准化债权类 资产	78,055,269.73	4.24%
6	西藏信托.绍兴市上虞杭州湾经开区 控股集团有限公司(第二期).云诚 22 号.债权封闭 261 号	非标准化债权类 资产	75,048,063.63	4.08%
7	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	67,341,634.93	3.66%
8	西藏信托.德阳经开区发展(控股) 集团有限公司理财融资项目(第二 期).云诚 20 号.债权封闭 261 号	非标准化债权类 资产	66,432,389.32	3.61%
9	国投瑞银优化增强债券 A/B	公募基金	52,490,164.02	2.85%
10	西藏信托.亳州文化旅游控股集团有 限公司.云旗 40 号.债权封闭 261 号	非标准化债权类 资产	50,035,032.11	2.72%

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	山东省新动能基金管理有限公司	建元信托.山东省新动能基金管理有限公司理财融资项目.启航鼎 27 号.债权封闭 261 号	信托贷款	3.9070	232	正常
2	湖州经开投资发展集团有限公司	上海信托.湖州经开投资发展集团有限公司理财融资项目(第二期).湖州 2 号.债权封闭 261 号	信托贷款	4.4300	232	正常
3	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(第二期).债权 261 号	信托贷款	4.2400	232	正常
4	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(第一期).债权 261.275 号	信托贷款	4.8200	232	正常
5	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(第一期).尊利 119 号.债	信托贷款	3.8000	231	正常

		权封闭 261 号				
6	绍兴市上虞杭州湾经开区控股集团有限公司	西藏信托.绍兴市上虞杭州湾经开区控股集团有限公司(第二期).云诚 22 号.债权封闭 261 号	信托贷款	4.6340	232	正常
7	德阳经开区发展(控股)集团有限公司	西藏信托.德阳经开区发展(控股)集团有限公司理财融资项目(第二期).云诚 20 号.债权封闭 261 号	信托贷款	5.1200	232	正常
8	亳州文化旅游控股集团有限公司	西藏信托.亳州文化旅游控股集团有限公司.云旗 40 号.债权封闭 261 号	信托贷款	4.8200	231	正常
9	玉环市国有资产投资经营集团有限公司	建元信托.玉环市国有资产投资经营集团有限公司(第二期).启航鼎 25 号.债权封闭 261 号	信托贷款	4.0900	231	正常
10	乌鲁木齐城市轨道交通集团有限公司	光大信托.乌鲁木齐城市轨道交通集团有限公司理财融资项目(第三期).鸿华 35 号.债权封闭 261 号.275 号	信托贷款	4.6300	232	正常

11	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(第三期).润昇财富 522 号.债权封闭 261.275 号	信托贷款	4.1000	232	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	1,283,662.61
中国建设银行股份有限 公司	112405145	24 建设银行 CD145	1,284,235.04

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	10257000000972697

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。