

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 256 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 256 号
理财产品代码	24121256
A 份额销售代码	24121256A
B 份额销售代码	24121256B
H 份额销售代码	24121256H
Z 份额销售代码	24121256Z
产品登记编码	Z7003924000020
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	106.00%
产品起始日期	2024-04-02
产品终止日期	2025-05-07

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	1.0174	1,483,206,831.00	1.0174	1,509,024,229.88

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)
2024-09-30	1.0169	294,651,578.00	1.0169	299,632,228.79

H 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	1.0176	1,200,000,000.00	1.0176	1,221,189,669.99

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	1.0166	397,244,589.00	1.0166	403,859,591.79

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	0.68%
成立以来	2024年4月2日-2024年9月30日	1.74%

B 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	0.65%
成立以来	2024年4月2日-2024年9月30日	1.69%

H 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	0.68%
成立以来	2024 年 4 月 2 日-2024 年 9 月 30 日	1.76%

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	0.63%
成立以来	2024 年 4 月 2 日-2024 年 9 月 30 日	1.66%

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	0.17%	6.73%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.23%
4	债券	0.00%	49.88%
5	非标准化债权类资产	43.54%	41.09%
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	1.40%	2.07%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	54.89%	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	西藏信托.郑州市金水控股集团有限公司.云旗 39 号.债权封闭 256 号	非标准化债权类资产	209,142,700.95	5.75%
2	西藏信托.武汉高科国有控股集团有限公司理财融资项目(第 4 期).云旗 35 号.债权封闭 256 号	非标准化债权类资产	179,387,629.87	4.93%
3	杭工信托.乌鲁木齐市盛天隆投资有限公司理财融资项目(第一期).尊利 123 号.债权 256 号	非标准化债权类资产	160,152,907.59	4.40%
4	陆家嘴信托.江苏武进高新投资控股有限公司.华禧 4 号.债权封闭 256 号	非标准化债权类资产	159,097,318.29	4.37%
5	西藏信托.无锡市太湖新城资产管理有限公司.云诚 26 号.债权 256 号.臻享 89 号.臻享 90 号	非标准化债权类资产	150,152,362.41	4.13%
6	上海信托.义乌市建设投资集团有限公司理财融资项目(第一期).债权封闭 256 号	非标准化债权类资产	139,108,062.31	3.82%
7	北方国际信托.徐州市新水国有资产经营有限责任公司.华悦 2 号.债权封闭 256 号.增强臻享 89 号.90 号	非标准化债权类资产	137,121,217.70	3.77%
8	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	131,605,292.61	3.62%
9	上海信托.成都空港产业兴城投资发展有限公司理财融资项目(第三期).债权封闭 256 号	非标准化债权类资产	100,072,543.46	2.75%
10	西藏信托.淮安市城市发展投资控股集团有限公司.云旗 37 号.债权封闭 256 号	非标准化债权类资产	95,090,835.30	2.61%

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	郑州市金水控股集团有限公司	西藏信托.郑州市金水控股集团有限公司.云旗 39 号.债权封闭 256 号	信托贷款	4.6303	219	正常
2	武汉高科国有控股集团有限公司	西藏信托.武汉高科国有控股集团有限公司理财融资项目 (第 4 期).云旗 35 号.债权封闭 256 号	信托贷款	4.5300	218	正常
3	乌鲁木齐市盛天隆投资有限公司	杭工信托.乌鲁木齐市盛天隆投资有限公司理财融资项目 (第一期).尊利 123 号.债权 256 号	信托贷款	4.5336	219	正常
4	江苏武进高新投资控股有限公司	陆家嘴信托.江苏武进高新投资控股有限公司.华禧 4 号.债权封闭 256 号	信托贷款	4.3987	219	正常
5	无锡市太湖新城资产经营管理有限公司	西藏信托.无锡市太湖新城资产经营管理有限公司.云诚 26 号.债权 256 号.臻享 89 号.臻享	信托贷款	4.7303	219	正常

		90号				
6	义乌市建设投资集团有限公司	上海信托.义乌市建设投资集团有限公司理财融资项目(第一期).债权封闭256号	信托贷款	3.9500	219	正常
7	徐州市新水国有资产经营有限责任公司	北方国际信托.徐州市新水国有资产经营有限责任公司.华悦2号.债权封闭256号.增强臻享89号.90号	信托贷款	4.2950	218	正常
8	成都空港产业兴城投资发展有限公司	上海信托.成都空港产业兴城投资发展有限公司理财融资项目(第三期).债权封闭256号	信托贷款	4.7700	219	正常
9	淮安市城市发展投资控股集团有限公司	西藏信托.淮安市城市发展投资控股集团有限公司.云旗37号.债权封闭256号	信托贷款	4.5352	219	正常
10	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256号	信托贷款	4.8200	219	正常
11	苏州相城高新技术产业发展有限公司	北京信托.苏州相城高新技术产业发展有限	信托贷款	4.0800	218	正常

		公司.润昇 492 号.债权封闭 256 号				
12	武汉高科国有控 股集团有限公司	西藏信托.武汉 高科国有控股 集团有限公司 (第 1 期).云旗 35 号.债权封闭 256 号	信托贷款	4.5700	218	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	263089	5 美意 1A	800,772.33
招商证券股份有限公司	263090	5 美意 1B	216,208.53

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	10257000000970247

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。