

华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财 产品 61 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 | 华夏理财固定收益增强型精选封闭式理财产品 61 号 |
| 理财产品代码 | 24151061 |
| A 份额销售代码 | 24151061A |
| 产品登记编码 | Z7003924000199 |
| 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 | 108.12% |
| 产品起始日期 | 2024-05-21 |
| 产品终止日期 | 2025-07-15 |

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

| 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 | 1.0084 | 213,493,251.00 | 1.0084 | 215,298,520.04 |

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 | 0.41% |
| 成立以来 | 2024年5月21日-2024年9月30日 | 0.84% |

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 | 0.52% | 0.65% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 10.71% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 1.06% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 75.45% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 11.60% | 10.74% |
| 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% | 1.40% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 87.89% | 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 | 北京信托.江门市滨江建设投资管理 有限公司.润昇财富 544 号.债权封闭 281 号.精选 61 号 | 非标准化债权类 资产 | 24,989,833.65 | 10.74% |
| 2 | 24 民生银行 CD230 | 同业存单 | 7,616,768.91 | 3.27% |
| 3 | 24 昆山高新 MTN002 | 债券 | 5,031,645.35 | 2.16% |
| 4 | 24 金外滩 MTN002 | 债券 | 4,976,522.13 | 2.14% |
| 5 | 24 国开 03 | 债券 | 4,310,398.48 | 1.85% |
| 6 | 24 恒泰 MTN002 | 债券 | 4,212,319.96 | 1.81% |
| 7 | 24 平安银行 CD067 | 同业存单 | 4,142,791.53 | 1.78% |
| 8 | 24 中国银行 CD025 | 同业存单 | 4,133,895.23 | 1.78% |
| 9 | 24 陆集 01 | 债券 | 3,538,134.29 | 1.52% |
| 10 | 24 兴城投资 MTN001 | 债券 | 3,525,637.38 | 1.51% |

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 | 江门市滨江建设投资管理有限公司 | 北京信托.江门市滨江建设投资管理有限公司.润昇财富 544 号.债权封闭 281 号.精选 61 号 | 信托贷款 | 4.0496 | 288 | 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） |
|------------------|-----------|----------------|--------------|
| 中国建设银行股份有限 公司 | 232380069 | 23 建行二级资本债 02A | 1,890,103.88 |

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

由于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

截止本报告日，产品持仓债券价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|-------------------|
| 1 | 托管账户 | 10257000000986543 |

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。