

# 华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 81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	华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 81 号
理财产品代码	24721081
产品登记编码	Z7003924A000023
产品募集方式	私募
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	117.55%
产品起始日期	2024-03-20
产品终止日期	2025-04-14

## 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	1.0187	2,000,000,000.00	1.0187	2,037,424,467.44

### 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	0.71%
成立以来	2024年3月20日-2024年9月30日	1.87%

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	0.21%	0.44%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	61.76%
5	非标准化债权类资产	44.10%	37.57%
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%	0.24%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	55.69%	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	上海爱建信托.温州市城市建设发展集团有限公司.温州城建 1 号.臻享封闭私募 73 号.81 号.82 号.83 号	非标准化债权类 资产	250,259,120.49	10.45%
2	上信信托.湖州市城市投资发展集团有限公司(第一期).臻享私募 73 号.81 号.82 号.83 号	非标准化债权类 资产	175,477,069.44	7.33%
3	光大信托.吉安城投控股集团有限公司.鸿华 26 号.臻享私募 73 号.81 号.82 号.83 号	非标准化债权类 资产	124,131,897.01	5.18%
4	光大信托.江苏海晟控股集团有限公司.鸿华 22 号.增强臻享私募 73 号.81 号.82 号.83 号	非标准化债权类 资产	112,785,682.81	4.71%
5	河南九鼎金融租赁股份有限公司理财融资项目 20241218 到期	非标准化债权类 资产	112,566,924.42	4.70%
6	北京信托.常德市金禹水利投资有限公司.润昇财富 500 号.臻享私募 73 号.81 号.82 号.83 号	非标准化债权类 资产	74,089,601.62	3.09%
7	中诚信托.消费授信付款资产(蚂蚁“花呗”)承接池信托计划理财投资项目(第 10 期)	非标准化债权类 资产	50,494,878.06	2.11%
8	22 中国信达债 01	债券	21,196,221.98	0.89%
9	22 首股 04	债券	19,997,994.48	0.83%
10	24 晋能电力 MTN002	债券	17,338,667.00	0.72%

### 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	温州市城市建设发展集团有限公司	上海爱建信托.温州市城市建设发展集团有限公司.温州城建1号.臻享封闭私募73号.81号.82号.83号	信托贷款	3.9000	79	正常
2	湖州市城市投资发展集团有限公司	上信信托.湖州市城市投资发展集团有限公司(第一期).臻享私募73号.81号.82号.83号	信托贷款	4.3400	196	正常
3	吉安城投控股集团有限公司	光大信托.吉安城投控股集团有限公司.鸿华26号.臻享私募73号.81号.82号.83号	信托贷款	4.3463	79	正常
4	江苏海晟控股集团有限公司	光大信托.江苏海晟控股集团有限公司.鸿华22号.增强臻享私募73号.81号.82号.83号	信托贷款	4.3835	196	正常
5	河南九鼎金融租赁股份有限公司	河南九鼎金融租赁股份有限公司理财融资项目20241218	同业借款	2.7000	79	正常

		到期				
6	常德市金禹水利投资有限公司	北京信托.常德市金禹水利投资有限公司.润昇财富 500 号.臻享私募 73 号.81 号.82 号.83 号	信托贷款	4.8280	79	正常
7	非特定消费信贷客户	中诚信托.消费授信付款资产(蚂蚁“花呗”)承接池信托计划理财投资项目(第 10 期)	信托贷款	3.8000	79	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）
北京农村商业银行股份有限公司	242400018	24 北京农商行永续债 01	1,719,672.90
天津中绿电投资股份有限公司	148562	23 绿电 G1	2,066,611.12

#### 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）
中诚信托有限责任公司	zcxthx18	中诚信托-汇鑫 18 号 集合资金信托计划	买入	40,000,000.00



#### 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

截至本报告日，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	10257000000969345

## 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。