

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 111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：招商银行股份有限公司

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 111 号
理财产品代码	24721111
产品登记编码	Z7003924A000061
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	107.64%
产品起始日期	2024-04-25
产品终止日期	2025-05-21

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	1.0132	121,480,000.00	1.0132	123,092,402.16

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	2024年4月25日-2024年9月30日	1.32%

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	0.44%	18.73%
2	同业存单	0.00%	3.44%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.81%
4	债券	0.00%	35.33%
5	非标准化债权类资产	41.44%	38.52%
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%	2.17%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	58.12%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	19,806,994.68	14.95%
2	西藏信托.济南高新控股集团有限公司.云旗 38 号.增强臻享私募 111 号.112 号	非标准化债权类资产	17,015,809.64	12.84%
3	上海信托.湖州市城市投资发展集团有限公司理财融资项目（第四期）.增强臻享 111 号.112 号	非标准化债权类资产	17,014,781.61	12.84%
4	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.增强臻享 111 号.112 号	非标准化债权类资产	17,014,582.01	12.84%
5	24 农行永续债 02	债券	2,583,023.26	1.95%
6	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	2,398,706.02	1.81%
7	24 民生银行二级资本债 01	债券	2,056,292.32	1.55%
8	建行溧阳嘉丰支行 20231215	现金及银行存款	1,208,800.97	0.91%
9	24 福建漳州 MTN001	债券	1,104,557.60	0.83%
10	22 章控 01	债券	1,038,495.57	0.78%

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	济南高新控股集团有限公司	西藏信托.济南高新控股集团有限公司.云旗38号.增强臻享私募111号.112号	信托贷款	4.5380	233	正常
2	湖州市城市发展集团有限公司	上海信托.湖州市城市发展集团有限公司理财融资项目(第四期).增强臻享111号.112号	信托贷款	4.3400	233	正常
3	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.增强臻享111号.112号	信托贷款	4.2950	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	232480032	24 兴业银行二级资本债 02	105,025.70

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	ZXD32Z2024 01010032472	中诚信托-汇鑫 30 号 集合资金信托计划	买入	15,000,000.00

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类、权益类资产(优先股),通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,产品持有的现金等高流动性资产比例符合要求,组合流动性风险可控。

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,债券价格波动对组合净值波动的影响保持在可控范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品无股票持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	110945467910005

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。