

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 83 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 83 号
理财产品代码	24721083
产品登记编码	Z7003924A000021
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	111.65%
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	1.0183	2,000,000,000.00	1.0183	2,036,625,520.94

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	0.84%
成立以来	2024年3月20日-2024年9月30日	1.83%

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	0.09%	0.37%
2	同业存单	0.00%	0.25%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.05%
4	债券	0.00%	50.46%
5	非标准化债权类资产	48.34%	43.34%
6	权益类投资	0.00%	0.05%
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%	5.48%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	51.57%	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	11.01%
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	7.72%
3	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	136,336,170.74	6.00%
4	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	5.46%
5	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	4.96%
6	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	4.95%
7	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	3.26%
8	23 上饶国资 PPN001A	债券	66,791,808.46	2.94%
9	23 中海 01	债券	49,456,574.05	2.17%
10	23 洛阳城乡 PPN002	债券	48,063,918.86	2.11%

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	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
4	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
5	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	信托贷款	4.3835	196	正常

		私募 73 号.81 号.82 号.83 号				
6	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 到期	同业借款	2.7000	79	正常
7	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

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	489,044.16
首钢集团有限公司	102380491	23 首钢 MTN002	83,899.35

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	ZC19KY	中诚信托-汇鑫 11 号 集合资金信托计划	买入	138,000,000.00

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,合理配置现金类、债券类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前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,债券价格波动处于市场合理区间范围。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日,本产品持有的权益类资产价格波动对组合净值波动的影响保持在可控范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截至本报告日,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	10257000000969301

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。