

# 华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 84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 84 号
理财产品代码	24721084
产品登记编码	Z7003924A000017
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	104.61%
产品起始日期	2024-05-21
产品终止日期	2025-11-24

## 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	1.0130	2,000,000,000.00	1.0130	2,026,056,326.49

### 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	0.93%
成立以来	2024年5月21日-2024年9月30日	1.30%

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	0.39%	0.68%
2	同业存单	0.00%	0.56%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	26.83%
5	非标准化债权类资产	75.09%	71.93%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	24.52%	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	民生金融租赁股份有限公司理财融资项目.臻享私募 84 号	非标准化债权类资产	500,011,629.85	23.59%
2	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 13 期)	非标准化债权类资产	321,538,133.06	15.17%
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 15 期)	非标准化债权类资产	200,595,951.64	9.46%
4	华能信托.（第 6 期）腾讯分付信托承接池理财融资项目.惠恒 9 号.臻享私募 124 号.臻享私募 84 号	非标准化债权类资产	199,118,348.98	9.39%
5	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 14 期)	非标准化债权类资产	170,803,163.46	8.06%
6	北京国际信托.梅州市康达公路建设有限公司理财融资项目	非标准化债权类资产	130,459,502.17	6.16%
7	24 湘高速 MTN003	债券	18,260,201.23	0.86%
8	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	14,420,840.66	0.68%
9	22 余杭创新 PPN003	债券	13,276,463.25	0.63%
10	19 长交 01	债券	12,383,962.06	0.58%

### 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	民生金融租赁股份有限公司	民生金融租赁股份有限公司理财融资项目. 臻享私募 84 号	同业借款	2.5500	133	正常
2	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 13 期)	信托贷款	3.0000	136	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 15 期)	信托贷款	3.0000	146	正常
4	非特定消费信贷客户	华能信托.(第 6 期) 腾讯分付信托承接池理财融资项目.惠恒 9 号.臻享私募 124 号.臻享私募 84 号	信托贷款	2.8900	353	正常
5	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 14 期)	信托贷款	3.0000	136	正常
6	梅州市康达公路	北京国际信托.	信托贷款	3.6140	84	正常

	建设有限公司	梅州市康达公路建设有限公司理财融资项目				
7	非特定消费信贷客户	华能信托.(第4期)腾讯分付信托承接池理财融资项目.惠恒6号.臻享84号.124号	信托贷款	3.2000	285	正常
8	非特定消费信贷客户	华能信托.(第5期)腾讯分付信托承接池理财融资项目.惠恒7号.臻享124号.臻享84号	信托贷款	3.1000	297	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	7,568,704.01

#### 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	fb20240801A	中诚信托-永成 601 号集合资金信托计划	买入	320,000,000.00
中诚信托有限责任公司	fb20240802A	中诚信托-永成 601 号集合资金信托计划	买入	170,000,000.00
中诚信托有限责任公司	fb20240823B	中诚信托-永成 601 号集合资金信托计划	买入	200,000,000.00

#### 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	10257000000986893

## 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。