

华夏理财固收增强臻享封闭私募理财产品 82号

2024年第4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10月1日至2024年12月31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 82 号
理财产品代码	24721082
产品登记编码	Z7003924A000022
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	100.79%
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)
2024-12-31	1.0268	2,000,000,000.00	1.0268	2,053,692,635.00

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09月30日-2024年12月31日	1.00%
成立以来	2024年03月20日-2024年12月31日	2.68%

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	0.04%	0.28%
2	同业存单	0.00%	11.67%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.18%
4	债券	0.00%	64.11%
5	非标准化债权类资产	14.02%	13.93%
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%	9.81%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	85.93%	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	175,585,666.67	8.48%
2	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	112,855,631.25	5.45%
3	21 埭桥城投 PPN001	债券	44,425,383.07	2.15%
4	24 平安银行 CD072	同业存单	39,467,353.38	1.91%
5	24 平安银行 CD071	同业存单	37,465,731.84	1.81%
6	24 保利发展 MTN003	债券	31,243,244.12	1.51%
7	22 青岛银行永续债 02	债券	28,792,795.14	1.39%
8	东财瑞利债券 A	公募基金	21,901,970.00	1.06%
9	22 建发集 MTN003	债券	21,151,422.78	1.02%
10	22 泰乡 01	债券	20,411,986.61	0.99%

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	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	104	正常
2	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	104	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）
-	-	-	-

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）
招商证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	2,853,953.54

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	ZXD32Z2023 1101003500X	中诚信托-汇鑫 23 号	买入	47,000,000.00

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向非标资产及资产管理计划。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，做好流动性管理。

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，本产品投资的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

截至本报告日，本产品无权益持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，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	10257000000969389

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。