

华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 8 号

2023 年第 1 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 3 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 8 号
理财产品代码	22121008
A 份额销售代码	22121008A
C 份额销售代码	22121008C
D 份额销售代码	22121008D
E 份额销售代码	22121008E
F 份额销售代码	22121008F
V 份额销售代码	22121008V
产品登记编码	Z7003922000078
产品募集方式	公募
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	127.63%
产品起始日期	2022-09-29
产品终止日期	2023-10-24

第二章 净值、存续规模及收益表现

A 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0127	24,740,000.00	1.0127	25,053,943.98	2.08%
2022-12-31	0.9921	24,740,000.00	0.9921	24,544,757.91	

C 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0117	78,465,403.00	1.0117	79,381,474.53	2.03%
2022-12-31	0.9916	78,465,403.00	0.9916	77,806,510.08	

D 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0112	157,129,499.00	1.0112	158,884,286.78	2.00%
2022-12-31	0.9914	157,129,499.00	0.9914	155,770,346.46	

E 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0124	693,823,455.00	1.0124	702,451,786.07	2.06%
2022-12-31	0.9920	693,823,455.00	0.9920	688,260,272.37	

F 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0119	12,072,000.00	1.0119	12,216,000.43	2.04%
2022-12-31	0.9917	12,072,000.00	0.9917	11,972,153.74	

V 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0117	220,000,000.00	1.0117	222,568,466.33	2.03%
2022-12-31	0.9916	220,000,000.00	0.9916	218,152,606.92	

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*100%

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	0.01%	0.24%
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%	72.27%
5	非标准化债权类资产	35.05%	27.49%
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	64.94%	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”类别中包含永续债和优先股。

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	粤财信托.连云港市城建控股集团有限公司理财融资项目(瑞兴 28 号)	非标准化债权类 资产	150,139,596.65	9.80%
2	温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年第九期债权融资计划	非标准化债权类 资产	100,801,849.00	6.58%
3	百瑞信托.珠江实业(百瑞恒益 1243 号)	非标准化债权类 资产	100,105,965.29	6.53%
4	中铁信托.北塘湾(天津)科技发展有限公司理财融资项目(泉熙 22166 期)	非标准化债权类 资产	70,097,995.01	4.57%
5	华恒 01 优	债券	30,749,201.28	2.01%
6	20 镇交 02	债券	26,623,446.34	1.74%
7	20 粤珠江 MTN003	债券	25,608,202.48	1.67%
8	21 金阳 02	债券	24,031,626.47	1.57%
9	22 河钢 K1	债券	24,012,612.95	1.57%
10	22 德达 01	债券	22,482,026.73	1.47%

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	连云港市城建控股集团有限公司	粤财信托.连云港市城建控股集团有限公司理财融资项目(瑞兴 28 号)	信托贷款	4.72	196	正常
2	温州市鹿城区国有控股集团有限公司	温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年第九期债权融资计划	债权融资计划	4.96	206	正常
3	广州珠江实业集团有限公司	百瑞信托.珠江实业(百瑞恒益 1243 号)	信托贷款	4.77	206	正常
4	北塘湾(天津)科技发展有限公司	中铁信托.北塘湾(天津)科技发展有限公司理财融资项目(泉熙 22166 期)	信托贷款	6.08	175	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	032380258.IB	23 常德城投 PPN004	1,434,407.69

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）
-	-	-	-	-

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份份额分红	每万份现金分红
-	-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品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、债券及非标准化债权类资产,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,产品投资的债券资产总体资质较优。根据公司理财资产风险分类的要求,持仓中 20 远资 01 (代码 175093.SH) 的资产风险分类为关注类,该券在产品持仓中占比不高于 0.08%,对产品净值影响较小。

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	10257000000892950

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。