

华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 91 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	华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 91 号
理财产品代码	22131091
产品登记编码	Z7003922000077
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	120.03%
产品起始日期	2022-08-02
产品终止日期	2025-07-22

第二章 净值、存续规模及收益表现

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	1.0192	279,975,109.00	1.0192	285,344,055.83	1.88%
2022-12-31	1.0004	279,975,109.00	1.0004	280,094,912.31	

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	5.62%	4.88%
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%	60.36%
5	非标准化债权类资产	41.63%	34.76%
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	52.74%	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	厦门信托.郑州投控流动资金贷款第一期.926 到期	非标准化债权类资产	61,010,543.61	17.81%
2	华鑫信托.肇庆新区投资发展有限公司理财融资项目(鑫深 76 号)	非标准化债权类资产	34,024,002.82	9.93%
3	百瑞信托.淄博生态产业新城投资发展集团有限公司理财融资项目(百瑞富诚 906 号)	非标准化债权类资产	24,029,327.31	7.02%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	16,699,559.23	4.88%
5	19 民生银行二级 01	债券	3,601,442.88	1.05%
6	20 民生银行二级	债券	3,229,323.85	0.94%
7	21 楚兴 ABN001 优先	债券	2,378,242.23	0.69%
8	22 建租 01	债券	1,978,752.92	0.58%
9	21 国开 07	债券	1,833,423.78	0.54%
10	20 饶城投绿债	债券	1,832,756.81	0.54%

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	郑州投资控股有限公司	厦门信托.郑州投控流动资金贷款第一期.926 到期	信托贷款	5.40	545	正常
2	肇庆新区投资发展有限公司	华鑫信托.肇庆新区投资发展有限公司理财融资项目(鑫深 76 号)	信托贷款	5.51	507	正常
3	淄博生态产业新城投资发展集团有限公司	百瑞信托.淄博生态产业新城投资发展集团有限公司理财融资项目(百瑞富诚 906 号)	信托贷款	5.79	528	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	894,454.31

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

由于产品为封闭式产品，确保在产品到期时均将持仓资产变现，投资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

截止本报告日，债券价格波动处于合理的市场波动区间。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，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	10257000000892597

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。