

# 华夏理财固定收益债权型封闭式理财产品 91号

## 2024年第1季度报告

### 重要信息提示：

- 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。
- 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1月1日至2024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 91 号
理财产品代码	23121091
产品登记编码	Z7003923000109
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	106.31%
产品起始日期	2023-03-24
产品终止日期	2024-09-24

## 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)	期间净值增 长率
2024-03-31	1.0447	47,956,752.00	1.0447	50,099,444.67	1.01%
2023-12-31	1.0343	47,956,752.00	1.0343	49,601,720.39	

注：期间净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值\*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	8.40%	7.99%
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	30.67%	52.47%
5	非标准化债权类资产	41.69%	39.47%
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%	0.07%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	19.24%	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	山东信托·岳阳市城市建设投资集团有限公司理财融资项目第三期(固收债权封闭 91 号/102 号)	非标准化债权类资产	20,018,904.75	37.59%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	4,257,906.25	7.99%
3	19 信投 01	债券	3,252,636.54	6.11%
4	22 漯河 03	债券	3,095,620.53	5.81%
5	21 水集 01	债券	3,088,032.43	5.80%
6	22 信诚 01	债券	3,076,363.69	5.78%
7	22 信地 03	债券	3,070,570.54	5.76%
8	中信信托·盐城市城市资产投资集团有限公司·第一期	非标准化债权类资产	1,001,592.60	1.88%
9	19 金水 02	债券	535,990.75	1.01%
10	22 金茂 03	债券	478,512.12	0.90%

### 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	岳阳市城市建设投资集团有限公司	山东信托.岳阳市城市建设投资集团有限公司理财融资项目第三期(固收债权封闭 91 号/102 号)	信托贷款	4.6200	176	正常
2	盐城市城市资产投资集团有限公司	中信信托.盐城市城市资产投资集团有限公司.第一期	信托贷款	5.0542	45	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）
-	-	-	-

#### 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，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	10250000003356708

## 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。