

华夏理财天工日开理财产品 6 号（微盘成长 低波指数）

2023 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：2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财天工日开理财产品 6 号（微盘成长低波指数）
理财产品代码	23802006
产品登记编码	Z7003923000237
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式
产品投资性质	权益类
投资及收益币种	人民币
产品风险评级	PR5 级（高风险）
杠杆水平	100.34%
产品起始日期	2023-07-07
产品终止日期	无特定存续期限

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
2023-12-31	1.0130	1,989,384.50	1.0130	2,015,246.03	1.82%
2023-09-30	0.9949	2,008,512.79	0.9949	1,998,241.17	

注：期间累计净值增长率=（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	0.18%	5.99%
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	0.00%	0.00%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	94.01%
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	99.82%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	121,061.30	5.99%
2	南京商旅	权益类投资	14,700.70	0.73%
3	天龙股份	权益类投资	14,309.85	0.71%
4	嘉华股份	权益类投资	13,237.35	0.65%
5	新瀚新材	权益类投资	11,822.30	0.58%
6	邦基科技	权益类投资	10,518.78	0.52%
7	常润股份	权益类投资	9,386.04	0.46%
8	泰嘉股份	权益类投资	9,236.17	0.46%
9	华培动力	权益类投资	9,200.82	0.45%
10	南京公用	权益类投资	9,048.96	0.45%

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
-	-	-	-	-	-	-

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

本产品为被动指数类产品，投资资产主要为跟踪指数标的成分股。资产均为具有良好流动性的股票及现金管理工具。四季度末，产品持有的股票市值占持有股票的自由流通市值合计的比例如下表。

产品名称	产品持有股票市值 (亿元)	持有股票的自由流通 市值合计(亿元)	占比
华夏理财天工日开理财产品 6 号(微 盘成长低波指数)	0.02	4465.58	0.0004%

可见投资组合持有股票资产可满足极端情况下的流动性变现要求。投资组合每日现金类资产占比不低于 5%，可满足日常的申赎需求。综上，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

本产品无债券持仓。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品为被动指数类产品，权益持仓采用全复制方式跟踪相应指数标的，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。四季度产品未发生因特殊原因（具体情形详见产品说明书）导致无法有效复制和跟踪标的指数的情况。

产品四季度权益持仓价格波动较大的标的如下表，四季度的区间涨跌幅绝对值超过 50%的有两只标的。考虑到指数成分股具有小市值高波动的属性，且成分股近 300 只，单只个股占比较小，对指数影响较小。两只个股可被认为在正常波动区间。

代码	简称	区间涨跌幅
603266.SH	天龙股份	107.5%
600250.SH	南纺股份	83.7%
002843.SZ	泰嘉股份	47.4%
301076.SZ	新瀚新材	44.8%
000421.SZ	南京公用	37.9%
603121.SH	华培动力	35.0%
002442.SZ	龙星化工	32.9%
001219.SZ	青岛食品	30.3%
300645.SZ	正元智慧	-31.3%

产品四季度净值涨跌幅为 1.82%，跟踪标的华夏理财微盘成长低波指数涨跌幅为 2.39%，产品与跟踪标的指数涨跌幅差异较小。



5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

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	10257000000939999

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。