

华夏理财天工日开理财产品 10 号（新能源 运营商指数）

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 10 号（新能源运营商指数）
理财产品代码	23802010
产品登记编码	Z7003923000240
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	100.20%
产品起始日期	2023-07-21
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	0.9096	1,970,498.31	0.9096	1,792,457.78	-0.47%
2023-09-30	0.9139	2,002,208.16	0.9139	1,829,719.42	

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	0.23%	6.79%
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%	93.21%
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	99.77%	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	122,006.00	6.79%
2	华能水电	权益类投资	95,374.56	5.31%
3	龙源电力	权益类投资	92,284.60	5.14%
4	中国核电	权益类投资	89,205.04	4.97%
5	清源股份	权益类投资	82,217.31	4.58%
6	三峡能源	权益类投资	77,315.49	4.30%
7	桂冠电力	权益类投资	58,754.40	3.27%
8	川能动力	权益类投资	57,959.49	3.23%
9	兆新股份	权益类投资	57,167.54	3.18%
10	新天绿能	权益类投资	55,601.50	3.10%

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 10 号 (新能源运营商指数)	0.02	2669.60	0.0006%

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均在正常波动区间。

代码	简称	区间涨跌幅
603628.SH	清源股份	59.1%
002256.SZ	兆新股份	17.6%
600025.SH	华能水电	16.3%

000155.SZ	川能动力	11.7%
000537.SZ	广宇发展	-12.2%
603105.SH	芯能科技	-13.1%
300125.SZ	聆达股份	-15.5%
600032.SH	浙江新能	-20.8%

产品四季度净值涨跌幅为-0.47%，跟踪标的华夏理财新能源运营商 30 指数涨跌幅为-0.36%，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	10257000000940188

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。