

华夏理财天工日开理财产品 5 号 (AI 算力指数)

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	华夏理财天工日开理财产品 5 号 (AI 算力指数)
理财产品代码	23802005
产品登记编码	Z7003923000234
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	100.90%
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)	期间净值增 长率
2024-03-31	0.7822	1,994,587.52	0.7822	1,560,201.66	-5.47%
2023-12-31	0.8275	1,966,374.34	0.8275	1,627,084.00	

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	0.71%	6.29%
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%	93.71%
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	99.29%	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	寒武纪	权益类投资	153,024.83	9.72%
2	长电科技	权益类投资	123,443.84	7.84%
3	通富微电	权益类投资	120,060.30	7.63%
4	海光信息	权益类投资	115,589.09	7.34%
5	华天科技	权益类投资	111,775.85	7.10%
6	景嘉微	权益类投资	110,328.15	7.01%
7	中国长城	权益类投资	104,486.69	6.64%
8	华润微	权益类投资	104,220.89	6.62%
9	中芯国际	权益类投资	103,322.86	6.56%
10	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	98,980.42	6.29%

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。一季度末，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5号(AI 算力指数)	0.01	3900.13	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。一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。

产品一季度权益持仓价格波动较大的标的如下表，区间涨跌幅均在正常波动范围内。

代码	简称	区间涨跌幅
----	----	-------

688256.SH	寒武纪-U	28.5%
603290.SH	斯达半导	-20.9%
688047.SH	龙芯中科	-21.1%
688249.SH	晶合集成	-22.5%
688347.SH	华虹公司	-27.3%
688521.SH	芯原股份	-29.8%

产品一季度净值涨跌幅为-5.47%，跟踪标的华夏理财 AI 算力指数涨跌幅为-5.64%，产品跑赢跟踪标的指数。



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	1025700000940348

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。