

华夏理财天工日开理财产品 1 号(水电指数)

2024 年第 3 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：2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财天工日开理财产品 1 号（水电指数）
理财产品代码	23802001
产品登记编码	Z7003923000232
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	100.59%
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

2.1 净值和存续规模

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)
2024-09-30	1.1950	2,438,640.51	1.1950	2,914,120.88

2.2 净值增长率

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年6月30日-2024年9月30日	-0.08%
成立以来	2023年7月7日-2024年9月30日	19.50%
2023年	2023年7月7日-2023年12月31日	-0.29%

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值*100%；因投资者赎回可能导致在某个时期部分份额为0，该情形下净值增长率的所属区间不连续；年末份额为0时，该年度净值增长率为空；**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，投资须谨慎。**

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	8.50%	8.50%
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	91.50%	91.50%
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	0.00%	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	华能水电	权益类投资	262,185.00	8.94%
2	长江电力	权益类投资	258,430.00	8.82%
3	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	249,092.79	8.50%
4	川投能源	权益类投资	241,280.00	8.23%
5	桂冠电力	权益类投资	238,656.00	8.14%
6	南网储能	权益类投资	236,720.00	8.08%
7	国投电力	权益类投资	230,520.00	7.86%
8	国电电力	权益类投资	222,082.00	7.58%
9	湖北能源	权益类投资	216,270.00	7.38%
10	三峡水利	权益类投资	123,768.00	4.22%

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）
华能澜沧江水电股份有限公司	600025	华能水电	276,670.54

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，投资标的主要为标的指数成份股。资产均为具有良好流动性的股票及现金管理工具。报告期末，投资组合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 1 号 (水电指数)	0.03	5779.46	0.0005%

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。

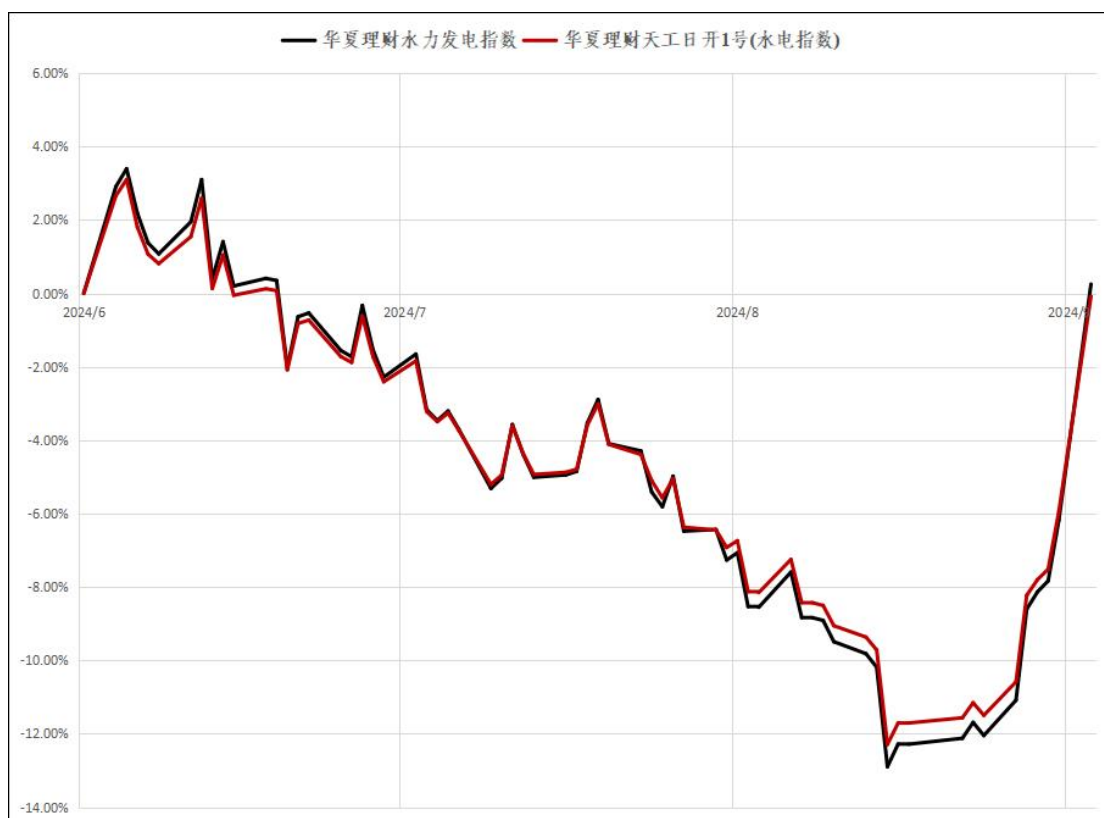
5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品为被动指数类产品，权益持仓采用完全复制法跟踪相应指数标的，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。报告期内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。

报告期内产品权益持仓价格波动较大的标的如下表。报告期内的区间涨跌幅均在正常波动范围内。

代码	名称	涨跌幅
600505.SH	西昌电力	-15.19%
600995.SH	南网储能	11.39%
000722.SZ	湖南发展	11.32%
000883.SZ	湖北能源	-11.15%
600116.SH	三峡水利	10.72%

产品报告期内净值涨跌幅为-0.08%，跟踪标的华夏理财水力发电指数涨跌幅为0.25%，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	10257000000939900

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。