

# 华夏理财天工日开理财产品13号(中证1000 指数)

## 2024 年半年度报告

### 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：国泰君安证券股份有限公司

报 告 期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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 13 号（中证 1000 指数）
理财产品代码	23802013
产品登记编码	Z7003923000511
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	100.03%
产品起始日期	2023-12-22
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)
2024-06-30	0.8499	22,090,510.38	0.8499	18,775,808.19

### 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1月1日-2024年6月30日	-15.40%
成立以来	2023年12月22日-2024年6月30日	-15.01%
2023年	2023年12月22日-2023年12月31日	0.46%

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	0.00%	5.84%
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%	94.16%
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	100.00%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,097,248.00	5.84%
2	欧菲光	权益类投资	87,868.65	0.47%
3	太平洋	权益类投资	71,903.27	0.38%
4	兴齐眼药	权益类投资	70,406.25	0.37%
5	胜宏科技	权益类投资	66,859.29	0.36%
6	兴业银锡	权益类投资	60,310.14	0.32%
7	万丰奥威	权益类投资	58,310.17	0.31%
8	润和软件	权益类投资	56,608.49	0.30%
9	久立特材	权益类投资	55,259.13	0.29%
10	平高电气	权益类投资	54,706.96	0.29%

### 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。半年末，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 13 号(中证 1000 指数)	0.18	46788.48	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。上半年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。

产品上半年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区间。

代码	简称	区间涨跌幅
002085.SZ	万丰奥威	170.7%
002130.SZ	沃尔核材	89.4%
601918.SH	新集能源	87.8%
000982.SZ	中银绒业	-87.8%

产品上半年净值涨跌幅为-15.40%，跟踪标的中证1000指数涨跌幅为-16.84%，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	216200100104817866

## 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。

## 第八章 托管人报告

2024年1月1日至2024年6月30日,本理财产品托管人——国泰君安证券股份有限公司在华夏理财天工日开理财产品13号(中证1000指数)的托管过程中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

报告期内,托管人对该产品的投资运作情况进行了监督,托管人未发现损害计划份额持有人利益的行为。

报告期内,由产品管理人所编制,并经托管人复核的有关华夏理财天工日开理财产品13号(中证1000指数)报告中的产品收益表现、主要财务指标、投资组合情况(其中第一章基本信息中杠杆水平、第三章资产持仓、第五章风险分析中涉及穿透部分托管人未做复核)等信息准确、完整。