
朱雀企业优胜股票型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:朱雀基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2021年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 朱雀企业优胜 |
| 基金主代码 | 008294 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年05月22日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,081,284,713.46份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金对宏观经济政策及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾宏观经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，在对证券市场当期的系统性风险及各类资产的预期风险收益进行充分分析的基础上，合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的投资权重，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险控制，适时地做出相应调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理</p> |

念,在宏观策略研究基础上,把握结构性调整机会,将行业分析与个股精选相结合,寻找具有投资潜力的细分行业和个股。企业在市场竞争中优胜劣汰,大浪淘沙。本基金将致力于寻找激烈竞争后优胜的企业,通过投资具有可持续竞争优势的上市公司或者未来具有广阔成长空间的公司来获得超越业绩比较基准的投资回报。

(1) 自上而下的行业遴选

本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业盈利前景和产业政策要素。对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等;对行业盈利前景,主要分析行业结构,特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等;对于产业政策要素,主要分析国家产业发展方向、政策扶持力度等因素,选择符合高标准市场经济要求的行业。

(2) 自下而上的个股选择

本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择:一方面是竞争力分析,通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析,选择具有可持续竞争优势的上市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略,基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果;就核心竞争力,分析公司的现有核心竞争力,并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得国际竞争力或者在国内市场具备难以复制的优势。另一方面是管理层分析,通过对公司管理层及公司治理结构的分析选择治理结构完善、管理层勤勉尽职的上市公司。

(3) 综合研判

本基金在自上而下和自下而上的基础上,结合估值分析,严选安全边际较高的个股,力争实现组合的保值增值。通过对绝对估值、相对估值方法的选择和综合研判,选择股价相对低估的股票。就相对估值方法而言,基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法(包括PE、PEG、PB、PS、EV/E BITDA等);就估值倍数而言,通过业内比较、历

史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。就绝对估值方法而言，基于行业和公司商业模式的特点，确定关键估值方法，包括股息贴现模型（DDM）、现金流贴现模型（DCF模型）、股权自由现金流贴现模型（FCFE模型）、公司自由现金流贴现模型（FCFF模型）等。

（4）港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将遵循上述股票投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

3、债券投资策略

本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

4、可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券同时具有债券与权益类证券的双重特性。本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券和可交换债券的特性选择各行业不同的券种。本基金利用可转换债券及可交换债券的债券底价和到期收益率来判断其债性，增强本金投资的相对安全性；利用可转换债券及可交换债券的溢价率来判断其股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

5、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| | <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，采用基本面分析和数量化模型相结合的方法对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。</p> <p>7、存托凭证投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> | |
| 业绩比较基准 | <p>沪深300指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债综合指数收益率*20%</p> | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> <p>本基金可投资于科创板上市的股票，除了需要承担与证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临投资科创板股票的特殊风险，本基金投资科创板的风险详见招募说明书。</p> | |
| 基金管理人 | 朱雀基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
| 下属分级基金的交易代码 | 008294 | 008295 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 958,917,850.56份 | 122,366,862.90份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2021年07月01日 - 2021年09月30日) | |
|------------|--------------------------------|---------------|
| | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
| 1. 本期已实现收益 | 102,808,429.78 | 12,923,362.98 |

| | | |
|-----------------|------------------|----------------|
| 2. 本期利润 | -56,640,154.09 | -7,950,530.89 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0554 | -0.0590 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,549,316,384.42 | 195,759,284.76 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.6157 | 1.5998 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

朱雀企业优胜A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -3.51% | 1.20% | -5.96% | 0.96% | 2.45% | 0.24% |
| 过去六个月 | 6.80% | 1.11% | -3.48% | 0.86% | 10.28% | 0.25% |
| 过去一年 | 27.71% | 1.40% | 5.34% | 0.94% | 22.37% | 0.46% |
| 自基金合同生效起至今 | 61.57% | 1.39% | 17.53% | 0.99% | 44.04% | 0.40% |

朱雀企业优胜C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去 | -3.70% | 1.20% | -5.96% | 0.96% | 2.26% | 0.24% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 三个月 | | | | | | |
| 过去六个月 | 6.38% | 1.11% | -3.48% | 0.86% | 9.86% | 0.25% |
| 过去一年 | 26.71% | 1.40% | 5.34% | 0.94% | 21.37% | 0.46% |
| 自基金合同生效起至今 | 59.98% | 1.39% | 17.53% | 0.99% | 42.45% | 0.40% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

朱雀企业优胜A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年05月22日-2021年09月30日)



朱雀企业优胜C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年05月22日-2021年09月30日)



注：

- 1、本基金建仓期为本基金合同生效之日（2020年5月22日）起6个月。
- 2、本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债综合指数收益率*20%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 梁跃军 | 公司总经理/基金经理 | 2020-06-03 | - | 15 | 梁跃军，经济学硕士。先后任职于招商银行股份有限公司北京分行、西南证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、上海朱雀投资发展中心（有限合伙）、朱雀股权投资管理有限公司。现任公司总经 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 理，担任朱雀企业优胜股票型证券投资基金、朱雀产业臻选混合型证券投资基金、朱雀企业优选股票型证券投资基金、朱雀匠心一年持有期混合型证券投资基金、朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：

- 1、“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在防范投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

统计相同投资策略的组合过去连续4个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3和T=5）存在同向交易价差的样本，并对溢价率均值、溢价率标准差、交易占优比、t值等指标进行分析，未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在二季度对持仓结构进行调整之后，三季度我们抓住7月下旬的调整提升了产品整体仓位。总体的考虑是立足明年，围绕双碳目标在相关产品品种上集中布局。

今年以来市场风格完成了阶段性的再平衡，从前两年实现超额收益的沪深300转向中证500，而上证50、沪深300指数今年收益为负，主要的原因在于中证500的盈利弹性强，ROE恢复较快（成分中材料行业权重较大），甚至高于疫情前水平。目前50/300/500/创业板指的PE(TTM)分位数分别处于近10年的71%/67%/9%/61%，当然，这其中中证500指数估值受到成分股调整的影响有所失真，50和300指数的估值经过2月以来的调整有所收敛。整体看，各指数估值分位接近。展望4季度和明年，目前主要指数的估值水平和盈利能力基本匹配，指数层面没有极端的定价偏离，在这种情况下，关注风格变化本身意义并不大。

近期房地产行业下行压力加大，部分房企信用风险暴露、土拍遇冷、销售下滑，但地产风险更多是经济结构调整过程中一次有序的压力测试，个体风险不会带来地产和金融体系的系统性风险。制造业和基建有望对冲房地产下滑，制造业投资持续高增长，基建将在今年底明年初发力形成实物工作量，新基建逐步接力老基建作为稳增长的抓手，宏观经济不存在失速风险。

宏观政策更加前瞻和多样化，从逆周期调节转变为跨周期政策设计，政策走在经济前面，在平滑短期经济波动的同时也兼顾长期的高质量发展和结构化转型，围绕十四五规划，以产业政策为本，明确发展路线图，摆脱传统的总量政策依赖。中国的经济发展模式已经从以往的“债务驱动”、“土地财政”向着新发展理念转变，专精特新、促科技发展、扶持中小企业的政策特征决定了股权融资的重要性，更需要健康的资本市场发挥合理配置资源的功能，助力实体经济发展。

3060（碳达峰碳中和）双碳政策树立了长期大背景，坚定走新能源替代传统能源的发展路线图，绿色能源将带来长期的投资需求。能源转型要“先立后破”、实现平稳替代，避免运动式减碳和“一刀切”；在“破”的过程中不可避免地带来传统能源的短期供需错配和涨价，但“立”比“破”更值得关注，建立绿色能源网是长期的正确方向，带来确定性的需求增量，所蕴含的投资价值远高于短期的商品价格博弈。市场担心大宗商品的涨价会抑制总需求，造成“滞涨”格局，但此轮涨价更多是供给端涨价，而非全社会通胀，货币政策作为需求端工具也不会因供给原因而收紧。各方逐渐意识到了运动式减碳的弊端，中小企业经营成本和连带的就业压力会反过来影响能耗双控的节奏。随着保供稳价政策的尽快推出，供需失衡和高价将会改善。

在权益市场没有系统性风险的前提下，市场整体定价较为均衡，我们的投资思路依然延续自下而上的基本面选股，遵循“产业逻辑配置，证券方法投资”，寻找确定性收益。坚定看好3060赛道上的优质企业成长机会，企业的长远发展必然会带来丰厚的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末朱雀企业优胜A基金份额净值为1.6157元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.51%，同期业绩比较基准收益率为-5.96%；截至报告期末朱雀企业优

胜C基金份额净值为1.5998元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.70%，同期业绩比较基准收益率为-5.96%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 1,632,952,485.41 | 93.35 |
| | 其中：股票 | 1,632,952,485.41 | 93.35 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 116,193,453.85 | 6.64 |
| 8 | 其他资产 | 211,308.56 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 1,749,357,247.82 | 100.00 |

注：权益投资中港股通股票公允价值为187,010,265.50元，占基金总资产比例10.69%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,045,391,012.69 | 59.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|------------------|-------|
| | 生产和供应业 | | |
| E | 建筑业 | 103,329,440.73 | 5.92 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 85,005,376.80 | 4.87 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 66,805,320.33 | 3.83 |
| J | 金融业 | 86,507,472.65 | 4.96 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 30,227,836.71 | 1.73 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 8,798,000.00 | 0.50 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 19,877,760.00 | 1.14 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,445,942,219.91 | 82.86 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 占基金资产净值比例(%) |
|----------|---------------|--------------|
| 基础材料 | 23,981,464.83 | 1.37 |
| 非日常生活消费品 | 10,766,017.59 | 0.62 |
| 日常消费品 | 21,172,219.90 | 1.21 |
| 医疗 | 53,650,313.59 | 3.07 |

| | | |
|------|----------------|-------|
| 保健 | | |
| 工业 | 18,871,508.11 | 1.08 |
| 信息技术 | 58,568,741.48 | 3.36 |
| 合计 | 187,010,265.50 | 10.72 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 002311 | 海大集团 | 1,511,040 | 101,844,096.00 | 5.84 |
| 2 | 603098 | 森特股份 | 2,279,000 | 91,387,900.00 | 5.24 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 1,714,717 | 86,507,472.65 | 4.96 |
| 4 | 300207 | 欣旺达 | 2,330,900 | 86,158,060.00 | 4.94 |
| 5 | 300433 | 蓝思科技 | 3,519,387 | 73,625,576.04 | 4.22 |
| 6 | 002352 | 顺丰控股 | 1,006,242 | 65,757,914.70 | 3.77 |
| 7 | 600893 | 航发动力 | 1,149,154 | 61,123,501.26 | 3.50 |
| 8 | H01810 | 小米集团-W | 3,293,000 | 58,568,741.48 | 3.36 |
| 9 | 603063 | 禾望电气 | 2,532,300 | 56,444,967.00 | 3.23 |
| 10 | 600438 | 通威股份 | 1,100,531 | 56,061,049.14 | 3.21 |

注：对于同时在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

603098森特股份：2021年1月6日，因重大事项未履行审议程序，未及时披露公司重大事件，受到上海证券交易所上市公司监管一部监管关注(上证公监函[2020]0147号)。

600036招商银行：因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局于2021年6月8日依据相关法规给予：公开处罚处分决定；因违规经营，中国银行保险监督管理委员会于2021年5月17日依据相关法规给予：罚款7170万元处分决定(银保监罚决字[2021]16号)；因违反规定办理结汇、售汇行为，国家外汇管理局深圳市分局于2020年11月27日依据相关法规给予：责令改正、罚款人民币55万元、没收违法所得128.82万元处分决定；因违反外汇市场交易管理行为，国家外汇管理局深圳市分局于2020年9月29日依据相关法规给予：责令改正、罚款人民币120万元、对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分决定。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司正常经营不会产生重大、实质性影响，对上述公司正常投资不会产生实质性影响，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序均符合相关法律法规及基金合同的要求。本基金管理人将持续对上述公司进行跟踪研究。

5.11.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 167,689.75 |
| 4 | 应收利息 | 43,618.81 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 211,308.56 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 300207 | 欣旺达 | 7,958,400.00 | 0.46 | 大宗交易流通受限 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
|-------------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,101,942,678.31 | 152,448,527.10 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 56,655,242.85 | 12,943,914.35 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 199,680,070.60 | 43,025,578.55 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 958,917,850.56 | 122,366,862.90 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
|------------------------------|--------------|---------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份 额 | 9,089,310.54 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份 额 | 9,089,310.54 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例(%) | 0.95 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有本基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予朱雀企业优胜股票型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《朱雀企业优胜股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《朱雀企业优胜股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《朱雀企业优胜股票型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务获批、营业执照
- 6、基金托管人业务获批、营业执照
- 7、关于申请募集注册朱雀企业优胜股票型证券投资基金的法律意见书
- 8、报告期内获批的各项公告

9.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人的办公场所

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.rosefinchfund.com）查阅。支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人朱雀基金管理有限公司。本公司客户服务电话：400-921-7211（全国免长途费）。

朱雀基金管理有限公司

2021年10月25日