

朱雀碳中和三年持有期混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2024年06月26日

送出日期：2024年06月27日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	朱雀碳中和三年持有	基金代码	015729
基金管理人	朱雀基金管理有限公司	基金托管人	宁波银行股份有限公司
基金合同生效日	2022年09月07日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每个开放日可申购，每笔份额的最短持有期限为三年
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
梁跃军	2022年09月07日		1999年10月01日
杨欣达	2023年09月07日		2018年05月31日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

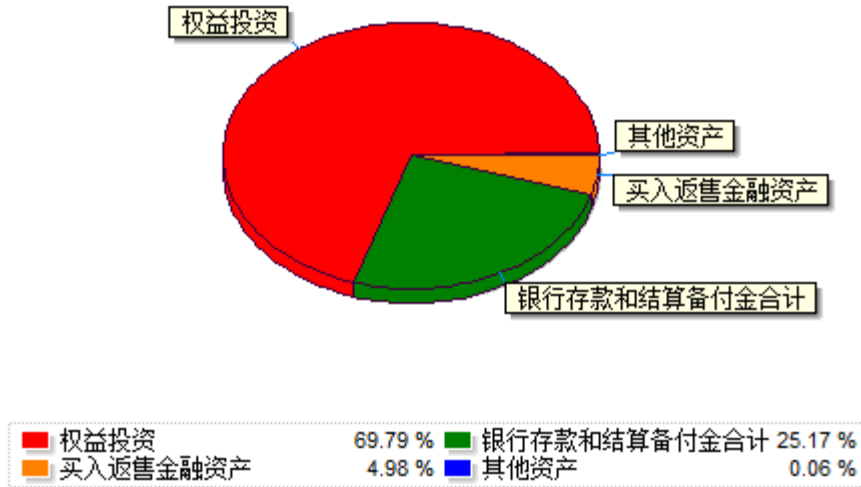
投资者可阅读《朱雀碳中和三年持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》第九章了解详细情况。

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。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票及存托凭证资产占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于本基金所界定的“碳中和”主题相关股票占非现金基金资产的比例不低于80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>

<p>主要投资策略</p>	<p>1) 主题股票投资策略: 本基金投资标的将围绕碳中和目标下减碳路径所涉及的相关产业链和行业。从碳排放源出发, 中国碳中和的减碳路径主要是电力行业脱碳化、工业行业节能化、交运行业电力化智能化、建筑行业绿色化, 以及其他支持碳中和目标的公共事业、TMT、绿色金融行业。2) 非主题股票投资策略: 本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念, 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。3) 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。4) 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。5) 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。6) 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。7) 资产支持证券投资策略: 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。8) 存托凭证投资策略: 本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证内地低碳经济主题指数*50%+恒生指数收益率*20%+沪深300收益率*10%+中债综合全价指数收益率*20%。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型发起式基金, 其风险和预期收益水平理论上高于债券型基金及货币市场基金, 而低于股票型基金。本基金可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>

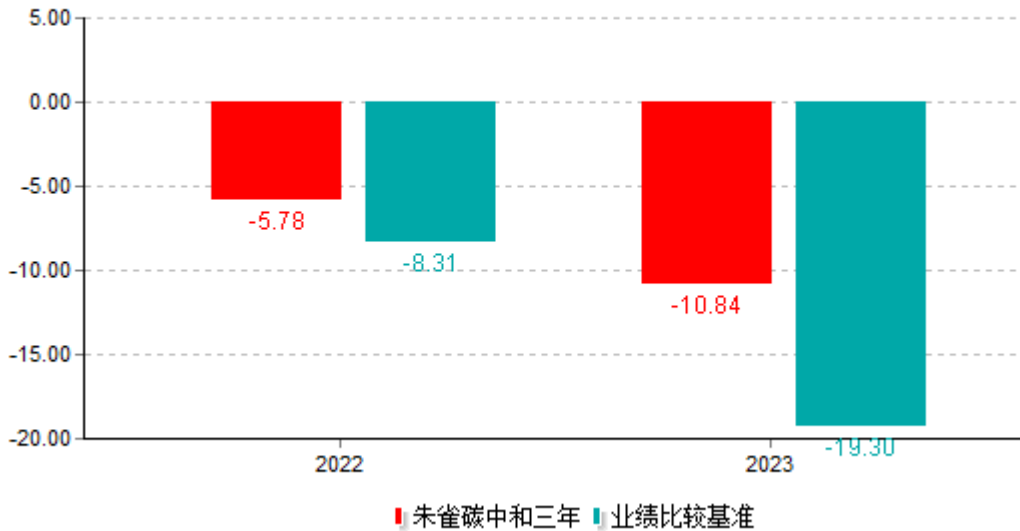
(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年03月31日



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日
单位%



注：合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

三、 投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
	M<100万	1.50%	

申购费（前收费）	100万≤M<500万	1.00%	
	M≥500万	1000.00元/笔	

注：本基金每份基金份额设置3年锁定持有期限，3年后方可赎回，赎回时不收取赎回费。

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	40,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、公证费、诉讼费和仲裁费、基金份额持有人大会费用、基金的证券/期货交易费用、基金的银行汇划费用、基金的开户费用、账户维护费用、因投资港股通标的而产生的各项合理费用和按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	相关服务机构

注：1、本基金不区分A/C类基金份额。本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、本基金审计费用、信息披露费为年金额，由基金整体承担，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
1.45%

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、 风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括但不限于以下风险：市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金投资策略所特有的风险、投资可转换债券和可交换债券的特定风险、投

资股指期货的特定风险、投资港股通标的股票的特定风险、投资流通受限证券的特定风险、投资资产支持证券的特定风险、投资存托凭证的特定风险、投资北交所股票的特定风险、基金管理人职责终止的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、其他风险等。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.rosefinchfund.com][客服电话：4009217211]

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

六、其他情况说明

无其他情况说明