

朱雀企业优胜股票型证券投资基金

2021年第4季度报告

2021年12月31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:2022年01月24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2022年01月17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10月01日起至2021年12月31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 | 1,055,685,083.76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/EBITDA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 | 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% | |
| 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 | 909,818,105.33份 | 145,866,978.43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10月01日 - 2021年12月31日) | |
|------------|--------------------------------|--------------|
| | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
| 1. 本期已实现收益 | 43,607,554.59 | 5,088,629.64 |

| | | |
|-----------------|------------------|----------------|
| 2. 本期利润 | 152,358,778.57 | 19,538,205.08 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1656 | 0.1531 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,617,191,650.68 | 256,206,346.98 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.7775 | 1.7564 |

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 | 10.01% | 0.93% | 0.54% | 0.61% | 9.47% | 0.32% |
| 过去六个月 | 6.16% | 1.08% | -5.45% | 0.81% | 11.61% | 0.27% |
| 过去一年 | 12.93% | 1.30% | -4.46% | 0.91% | 17.39% | 0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 77.75% | 1.33% | 18.17% | 0.94% | 59.58% | 0.39% |

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 | 9.79% | 0.93% | 0.54% | 0.61% | 9.25% | 0.32% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 三个月 | | | | | | |
| 过去六个月 | 5.73% | 1.08% | -5.45% | 0.81% | 11.18% | 0.27% |
| 过去一年 | 12.04% | 1.30% | -4.46% | 0.91% | 16.50% | 0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 75.64% | 1.33% | 18.17% | 0.94% | 57.47% | 0.39% |

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12月31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、朱雀产业智选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遵规守信情况的说明

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

四季度以来，市场整体呈现震荡走势，主要指数窄幅波动。产品操作层面，我们保持高仓位运作，进一步聚焦“双碳”领域，产品净值稳步上涨。

2021年是市场主要指数波动幅度较小的一年，但从各行业板块表现来看分化差异较大，首尾相差近70%；投对了行业和方向，产品净值会有不错的表现。我们坚持产业链研究方法，在此基础上“以我为主”进行投资布局，始终把获取绝对收益放作为主要考虑因素，产品净值在一季度经历调整回撤后，从5月开始稳步上行并逐步收复回撤。

展望明年，经济下行压力较大现在已被市场普遍关注，中央经济工作会议及时出台了应对举措，并对五个关系到中长期发展需要正确认识和把握的重大理论和实践问题进行了阐述，包括：共同富裕的战略目标和实现途径，资本的特性和行为规律，初级产品供给保障，防范化解重大风险，碳达峰碳中和。我们认为从宏观角度看市场没有大的风险。在经济维稳的大前提下，流动性偏宽松已经是事实，对资本市场总体友好。这也是我们一直以来的观点。

我们在2021年四季度提出聚焦双碳领域的投资策略，2022年我们依然维持这样的看法。双碳领域的品种在过去的一年市场已经有比较充分的挖掘，我们继续聚焦这一领域还会有什么新的投资机遇？我们知道，双碳领域的公司大多属于制造业，这也是新能源与传统能源最大的不同。新能源替代传统能源靠的是不断的技术进步带来的发电成本的下降，科技创新在这一过程中起到了关键作用。光伏电池、新能源动力电池和电化学储能电池的技术创新对相关领域的发展有决定性的影响，由此对上游矿产资源、中游材料和电池制造等整个产业链都会带来变化，把握并紧跟电池技术变化的趋势在一定程度上能够抓住产业发展的脉络，从而获取新的投资机会。

双碳相关板块市场已经给予较高估值，继续聚焦投资的风险收益如何考虑？我们认为，估值是一个动态变化的过程，我们看好双碳相关领域的投资机会主要是从中长期来考虑，这个领域属于那种“长坡厚雪”的赛道，是可以做长期投资打算的。此外，估值高不能简单的用长期需求来解释，双碳领域以制造业公司为主，技术领先优势会带来制造成本优势从而赢得市场，但要持续保持这种优势必须有持续的变革创新能力，而有这样能力的公司就属于凤毛麟角了。因此我们对板块整体的高估值会保持警惕，但对其中有持续创新能力从而保持优势的公司会予以高度重视。

如果说2021年双碳板块整体表现比较突出，那么2022年光看好板块整体是远远不够的，核心的变量来自技术变革创新，这是制造业的特点也是投资把握的难点。在充分竞争的市场环境下，能够引领技术变革的公司是少数，而能够抓住变革机遇积极配套产业变化的公司也不会很多，双碳领域的投资将从板块聚焦到公司个体。聚焦双碳，我们已经做了充分的研究积淀和品种储备。

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1.7775元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.01%，同期业绩比较基准收益率为0.54%；截至报告期末朱雀企业优

胜C基金份额净值为1.7564元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.79%，同期业绩比较基准收益率为0.54%。

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 | 1,753,654,116.47 | 93.46 |
| | 其中：股票 | 1,753,654,116.47 | 93.46 |
| 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 | 122,685,996.12 | 6.54 |
| 8 | 其他资产 | 35,097.96 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 1,876,375,210.55 | 100.00 |

注：权益投资中港股通股票公允价值为186,049,748.81元，占基金总资产比例9.92%。

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 | 1,176,690,304.78 | 62.81 |
| D | 电力、热力、燃气及水生 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|------------------|-------|
| | 产和供应业 | | |
| E | 建筑业 | 137,603,529.88 | 7.35 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 85,601,534.64 | 4.57 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 81,457,887.39 | 4.35 |
| J | 金融业 | 40,103,771.07 | 2.14 |
| 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 | 25,769,521.28 | 1.38 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,702,325.62 | 1.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,675,493.00 | 0.09 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,567,604,367.66 | 83.68 |

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 | 20,866,460.16 | 1.11 |
| 非日常生活消费品 | 36,416,885.12 | 1.94 |
| 日常消费品 | 19,524,206.24 | 1.04 |
| 医疗保健 | 34,695,571.40 | 1.85 |
| 工业 | 36,511,497.79 | 1.95 |
| 信息技术 | 38,035,128.10 | 2.03 |
| 合计 | 186,049,748.81 | 9.93 |

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 | 1,590,240 | 116,564,592.00 | 6.22 |
| 2 | 603063 | 禾望电气 | 2,473,100 | 99,690,661.00 | 5.32 |
| 3 | 603098 | 森特股份 | 1,967,100 | 92,394,687.00 | 4.93 |
| 4 | 002352 | 顺丰控股 | 1,242,042 | 85,601,534.64 | 4.57 |
| 5 | 601012 | 隆基股份 | 870,640 | 75,049,168.00 | 4.01 |
| 6 | 300433 | 蓝思科技 | 3,126,987 | 71,858,161.26 | 3.84 |
| 7 | 000792 | 盐湖股份 | 1,870,100 | 66,182,839.00 | 3.53 |
| 8 | 300724 | 捷佳伟创 | 557,700 | 63,745,110.00 | 3.40 |
| 9 | 600893 | 航发动力 | 982,554 | 62,352,876.84 | 3.33 |
| 10 | 300124 | 汇川技术 | 859,650 | 58,971,990.00 | 3.15 |

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 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

603063 禾望电气：2021年9月29日，就公司股东减持股份事项明确监管要求，受到上海证券交易所监管关注(上证公函[2021]2776号)。

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)。

000792 盐湖股份：2021年9月17日，因价格垄断，捏造、散布涨价信息，哄抬价格，受到市场监管总局整改通知，责令立即改正并罚款160万元(市监处罚[2021]71号)。2021年10月11日，因未及时履行相关审议程序及披露义务，收到深圳证券交易所的监管函(公司部监管函(2021)第156号)。2021年10月27日，因未及时履行相关临时信息披露义务，收到深圳证券交易所的监管函(公司部监管函(2021)第163号)。

300724 捷佳伟创：2021年11月1日，因披露限制性股票激励计划未详细说明业绩考核指标确定依据等，受到深圳证券交易所监管关注(创业板关注函[2021]第440号)。

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 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

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 | - |
| 4 | 应收利息 | 35,097.96 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 35,097.96 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 | 958,917,850.56 | 122,366,862.90 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 82,390,475.15 | 41,455,389.84 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 131,490,220.38 | 17,955,274.31 |
| 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 | 909,818,105.33 | 145,866,978.43 |

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 (%) | 1.00 | - |

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

2022年01月24日